

INHALTSVERZEICHNIS		Seite
Vorwort		I
Verzeichnis der Tabellen		V
Symbolverzeichnis		VIII
1	Einleitung	1
1.1	Zur Problematik der Parameter- schätzung in bestimmten ökonome- trischen Modellen der praktischen Wirtschaftsordnung	1
1.2	Zielsetzung dieser Arbeit	6
1.3	Überblick über Ergebnisse einiger vergleichbarer Monte-Carlo-Studien	8
1.4	Aufbau dieser Arbeit	15
2	Darstellung des ökonometrischen Modells	17
2.1	Modellannahmen	17
2.2	Reduzierte Form des Modells	24
2.3	Eigenschaften der Störvariablen und der endogenen Variablen	26
2.4	Identifikation der Parameter	31
3	Darstellung der untersuchten Schätzverfahren und ihrer asymptotischen Eigenschaften	35
3.1	Methode der kleinsten Quadrate	35
3.2	Methode der Instrumentvariablen	37
3.3	FIDA-Verfahren	40
4	Planung des Monte-Carlo-Experiments und Erzeugung der Daten	53
4.1	Vorüberlegungen und Planung des Experiments	53
4.2	Festlegung der Eigenschaften der exogenen Variablen	55
4.3	Auswahl der Modelle für die Simulationsstudie	60

	Seite	
4.4	Auswahl der Werte für die Modellparameter	65
4.5	Die Gewinnung der Zufallszahlen für die Monte-Carlo-Studie	67
4.6	Praktische Erzeugung der Stich- proben für die exogenen Variablen	69
4.7	Gewinnung der Daten für die endogenen Variablen	71
5	Schätzung von Gütemaßen	73
5.1	Verwendete Gütemaße für die Beurteilung der untersuchten Schätzverfahren	73
5.1.1	Gütemaße für die Schätzung einzelner Parameter	74
5.1.2	Gütemaße für die Schätzung von Parametervektoren	78
5.2	Eigenschaften der Schätzfunktionen für die Gütemaße	78
5.3	Verwendung von antithetischen Variablen	83
5.3.1	Theoretischer Hintergrund der Methode der antithetischen Variablen	83
5.3.2	Beispielsrechnungen	87
6	Gütevergleich der Schätzverfahren	99
6.1	Eigenschaften der Schätzer in Modell I	102
6.1.1	Beurteilung anhand des durchschnitt- lichen Medianabstandes	102
6.1.2	Beurteilung mit Hilfe des durchschnitt- lichen 95%-Quantilsabstandes	107
6.1.3	Schätzwerte für den durchschnittlichen Mean-Square-Error	111
6.1.4	Gesamtbeurteilung der Schätzer für Modell I	113

	Seite	
6.2	Eigenschaften der untersuchten Schätzverfahren in den Modellen II und III	117
6.2.1	Beurteilung der Verfahren in Modell II	117
6.2.2	Gütebeurteilung in Modell III	122
7	Schätzung von "Response Surfaces"	128
7.1	Ein Regressionsmodell	129
7.2	Regressionsfunktion I	134
7.3	Regressionsfunktion II	143
8	Zusammenfassung	150
Anhang A:	Parameterstrukturen, Schätzergebnisse und Datenreihen	156
Anhang B:	Numerische Probleme	180
Literaturverzeichnis		182