

Inhaltsverzeichnis

0. Einleitung

Kapitel 1: Grundlagen der empirischen Wirtschaftsforschung

I. Wissenschaftstheoretische Grundlagen der empirischen Wirtschaftsforschung	7
1. Die Struktur wissenschaftlicher Theorien	8
2. Die Anwendung wissenschaftlicher Theorien	10
2.1. Die Verwendung von Theorien zur Erklärung	10
2.2. Die Verwendung von Theorien zur Prognose	12
2.3. Die „technologische“ Verwendung theoretischer Aussagensysteme	12
3. Probleme der Symmetrie von Erklärung und Prognose	12
II. Die Datenbasis der empirischen Wirtschaftsforschung	16
1. Das Abbildungsproblem theoretischer Konstrukte	16
1.1. Operationalisierung und Messung	17
1.2. Die Bedeutung des Meßniveaus	21
2. Die Datensammlung	22
2.1. Die verfügbaren Daten	23
2.1.1. Arbeitsweise und Publikationen des Statistischen Bundesamtes	24
2.1.2. Deutsche Bundesbank und Bundesanstalt für Arbeit	28
2.1.3. Ausgewählte statistische Veröffentlichungen der nichtamtlichen Statistik	29
2.1.4. Sonstige Datenquellen	31
2.1.4.1. Internationale Statistik	31
2.1.4.2. Sozialindikatoren	34
2.1.5. Hinweise zur Sammlung wirtschaftsstatistischer Daten	36
2.2. Die nicht verfügbaren Daten	39
III. Die Datenaufbereitung	44
1. Einfache Methoden der Informationsverdichtung	44
1.1. Die graphische Darstellung	46
1.2. Statistische Maßzahlen	50

2. Die Saisonbereinigung	54
2.1. Das Bundesbankverfahren	56
2.2. Das Census-Verfahren	58
2.3. Das Berliner Verfahren	62
2.4. Berücksichtigung der Saisonkomponente durch 0,1-Variable	68

Kapitel 2: Ökonomische Indikatoren

IV. Grundlagen konjunktureller Indikatoren	71
1. Entwicklung der Konjunkturbeobachtung	72
2. Kriterien der Indikatorenbildung	75
3. Systematisierung konjunktureller Indikatoren	76
V. Einfache Indikatoren	80
1. Preisindikatoren	81
2. Arbeitsmarktindikatoren	86
3. Außenhandelsindikatoren	90
4. Wachstumsindikatoren	95
5. Verteilungsindikatoren	101
VI. Komplexe Indikatoren	107
1. Das Konzept der gesamtwirtschaftlichen Kapazitätsauslastung	107
1.1. Die Ermittlung des Produktionspotentials durch den Sachverständigenrat	108
1.2. Die Ermittlung des Produktionspotentials durch die Deutsche Bundesbank	111
2. Die Konstruktion von Gesamtindikatoren	114
2.1. Die Verwendung von Diffusionsindizes	115
2.2. Die Anwendung der Signalwertmethode	116
2.2.1. Der Gesamtindikator des SVR	117
2.2.2. Der WSI-Konjunkturindikator	122
2.3. Der MNV-Indikator	123
2.4. Der Komponentenindikator des Instituts der deutschen Wirtschaft	125
2.5. Das Problem der Auswahl von Datenreihen	133
VII. Subjektive Indikatoren	135
1. Der IFO-Konjunkturtest	136
1.1. Das Frageprogramm	136
1.2. Die Auswertung	137

2. Der Investitionstest	139
2.1. Das Frageprogramm	139
2.2. Die Auswertung	140
3. Indikatoren des Konsumentenverhaltens	141
3.1. Amerikanische Untersuchungen	141
3.2. Ansätze in der BRD	142

Kapitel 3: Input-Output-Technik

VIII. Die Input-Output-Tabelle als Datensystem	146
1. Input-Output-Tabelle und Kreislaufanalyse	146
2. Konzeptionelle Probleme bei der Aufstellung von Input-Output- Tabellen	153
2.1. Größe und Arten von Input-Output-Tabellen	153
2.2. Prinzipien der Sektorenbildung	154
2.3. Die Auswahl der Wirtschaftssektoren	155
2.4. Die Erfassung und Bewertung der Transaktionen	157
3. Empirisch-statistische Probleme bei der Aufstellung von Input- Output-Tabellen	158
3.1. Das statistische Datenmaterial	158
3.2. Die Fehlerquellen	158
IX. Die Input-Output-Analyse	160
1. Das offene statische Input-Output-Modell	160
2. Statische Input-Output-Modelle und veränderte Koeffizien- ten	163
2.1. Sensibilitätsanalyse des statischen offenen Leontief-Mo- dells	164
2.2. Die zeitliche Anpassung der Koeffizientenmatrix	166
2.2.1. Einfach-proportionale Input-Output-Modelle	167
2.2.2. Doppelt-proportionale Input-Output-Modelle	168
2.2.3. Zufallsmodelle	168
2.2.4. Koeffizienten-Trend-Modell	169
2.2.5. Restverteilungsmodelle	170
2.2.6. Regressions- und Programmierungsmodelle	171
2.2.7. Einige Anwendungen	171
3. Statische Input-Output-Modelle mit endogenisierter Endnach- frage	172
4. Dynamische Input-Output-Modelle	179

Kapitel 4: Ökonometrie

X. Skizzierung der ökonometrischen Vorgehensweise	183
1. Spezifikation des Modells	184

1.1. Die Variablen des Modells	185
1.2. Die mathematische Form des Modells	187
1.3. Die Parameter des Modells	191
2. Das Schätzproblem	191
2.1. Die mathematisch-statistische Beschaffenheit	192
2.2. Die Qualität der Schätzwerte	193
3. Die Prüfung der ökonomischen Struktur	193
4. Die Bewertung der Ergebnisse	194
5. Ablaufdiagramm der ökonomischen Vorgehensweise	194
XI. Spezifikation und Schätzung von Einleichungsmodellen	196
1. Das lineare Regressionsmodell	197
2. Parameterschätzung des linearen Regressionsmodells	199
2.1. Die Eigenschaften der Störvariablen u	200
2.2. Die Schätzung der Parameter mit der Kleinstquadratmethode	201
2.2.1. Die gewöhnliche Kleinstquadratmethode (OLS)	202
2.2.2. Die verallgemeinerte Methode der kleinsten Quadrate (GLS)	205
2.2.3. Die statistische Qualität der Regression	207
3. Die Verletzung von Modellannahmen	209
3.1. Heteroskedastische Störvariablen	210
3.2. Autokorrelierte Störvariablen	214
3.3. Multikollinearität der exogenen Variablen	223
XII. Spezielle methodische Probleme bei Mehrgleichungsmodellen	228
1. Rekursive Mehrgleichungsmodelle	230
2. Interdependente Mehrgleichungsmodelle	233
2.1. Das Schätzproblem	233
2.2. Einfache Ansätze zur Schätzung interdependenter Systeme	235
2.2.1. Die Umwandlung von interdependenten Modellen in rekursive Modelle	235
2.2.2. Schätzung der reduzierten Form	236
2.3. Direkte Schätzverfahren	237
2.3.1. Das Identifikationsproblem	237
2.3.2. Schätzmethoden	241
2.3.2.1. Die indirekte Kleinst-Quadratmethode (ILS)	241
2.3.2.2. Die Methode der Hilfsvariablen (IV)	242
2.3.2.3. Die zweistufige Kleinst-Quadrat-Methode (2 SLS)	242

**Kapitel 5: Die Erklärungs- und Prognoseleistung
der empirischen Wirtschaftsforschung**

XIII. Quantitative Maße zur Bewertung von Erklärungen und Prognosen	249
1. Der Gegenstand der Bewertung	250
2. Bewertungsmaße	251
2.1. Maße zur Bewertung der Anpassungsgüte	252
2.1.1. Der Standardfehler $s_{\hat{u}}$	253
2.1.2. Das Bestimmtheitsmaß R^2	253
2.1.3. Die Durbin-Watson-Testgröße d_w	257
2.1.4. Die Bildung von Konfidenzintervallen	257
2.2. Prediktive Tests	258
2.2.1. Tendenzanalyse	259
2.2.2. Genauigkeitsanalyse	263
2.2.3. Strukturbruchanalyse	268
3. Wissenschaftstheoretische Beurteilung von Bewertungsmaßen ..	270
XIV. Neuere Ansätze zur Verbesserung der Erklärungs- und Prognosegüte	272
1. Ein Ansatz zur Verbesserung ökonomischer Prognosen: Fine-tuning	273
2. Ein Ansatz zur Bewertung von Instrumentvariationen: Multiplikatoranalyse	279
3. Ansätze zur Modellverknüpfung	282
3.1. „Weiche“ Modellbildung	282
3.2. Ökonometrische Input-Output-Prognosemodelle	285
Stichwortverzeichnis	289