

# Minimax-Schätzer im simultanen Gleichungsmodell bei vollständiger und partieller Vorinformation

1.	Modellbildung unter a priori Information	
1.1	Einleitung .....	3
1.2	Das ökonometrische Modell simultaner Gleichungen (SEM) .....	4
1.3	Vorinformation und Bayes-Verfahren .....	9
1.4	A priori Information über Strukturparameter .....	12
1.5	A priori Information über Parameter der reduzierten Form .....	19
1.6	Über Zusammenhänge zwischen den Parametern der strukturellen und der reduzierten Form .....	24
2.	Traditionelle Schätzverfahren im SEM	
2.0	Einleitung .....	26
2.1	Einzelgleichungsschätzer der strukturellen Form .....	26
2.2	Verbesserte Einzelgleichungsschätzer der strukturellen Form .....	32
2.3	Schätzverfahren unter linearen Restriktionen .....	35
2.4	Traditionelle und verbesserte Schätzung der strukturellen Form im Mehrgleichungsmodell .....	37
3.	Minimax-Schätzer im simultanen Gleichungsmodell bei vollständiger Information	
3.1	Das Minimax-Prinzip im Kontext alternativer Schätzkonzepte .....	42
3.2	Grundlagen des Minimax-Prinzips .....	45
3.3	Minimax-Schätzer in Einzelgleichungsmodellen der strukturellen Form .....	48
3.4	Approximative Minimax-Schätzer im SEM .....	56
3.5	Asymptotische Eigenschaften approximativer Minimax-Schätzer ...	62
3.6	Approximative Minimax-Schätzer unter linearen Zusatzrestriktionen	66
3.7	Approximative Minimax-Schätzer im Mehrgleichungsmodell .....	72
3.8	Schätzung unter linearen Zusatzrestriktionen .....	76

<b>4. Minimax-Schätzer bei partieller Information</b>	
4.0 Einleitung .....	79
4.1 Partielle Minimax-Schätzer der strukturellen Form .....	80
4.2 Schätzung unter zusätzlichen Linearrestriktionen .....	83
4.3 Partielle Schätzung im Mehrgleichungsmodell .....	85
4.4 Schätzung im Mehrgleichungsmodell unter linearen Zusatzrestriktionen .....	87
<b>5. Minimax-Schätzung der reduzierten Form</b>	
5.0 Einleitung .....	89
5.1 Minimax-Schätzung in Einzelgleichungsmodellen .....	90
5.2 Partielle Schätzung der reduzierten Form in Mehrgleichungsmodellen .....	93
<b>6. Anwendungsmöglichkeiten der Schätzverfahren in der empirischen Ökonometrie</b>	
6.1 Haavelmo-Modell .....	95
6.2 Schätzung von Produktionsfunktionen .....	97
<b>7. Finite Eigenschaften von Minimax-Schätzern in simultanen Gleichungsmodellen - Simulationsstudien -</b>	
7.0 Einleitung .....	100
7.1 Simulation approximativer Minimax-Schätzer bei vollständiger und partieller Vorinformation .....	101
<b>8. Zusammenfassung und Ausblick</b> .....	135
<b>9. Anhang</b>	
9.1 Matrix-Algebra .....	138
9.2 Das Simulationsdesign im Detail .....	139
<b>10. Literaturverzeichnis</b> .....	142