

Inhaltsverzeichnis

	<u>Seite</u>
Einleitung: Das Vorhaben	1
<u>I. Ökonometrische Modelle</u>	
1. Das stochastische Konzept, Modell- und Strukturbegriff in der Ökonometrie	6
2. Lineare Modelle als Untersuchungsobjekte	11
<u>II. Die Theorie statistischer Tests</u>	14
1. Zum Wesen statistischer Tests	14
2. Eigenschaften statistischer Tests	19
3. Verfahren zur Konstruktion statistischer Tests	25
<u>III. Der t-Test zur Prüfung von Parameterhypothesen im klassischen linearen Modell der Normal- regression</u>	29
1. Notationen und Annahmen des Modells	29
2. Schätzfunktionen und ihre Eigenschaften	32
3. Herleitung der Teststatistik und Macht- funktion des t-Tests	35
4. Methoden zur Berechnung der Macht des t-Tests	49
4.1 Die Momente, Dichte- und Verteilungs- funktion der nichtzentralen t-Ver- teilung	49
4.2 Approximationen für die Verteilungs- funktion der nichtzentralen t-Ver- teilung	54
4.3 Numerischer Vergleich der verschiedenen Methoden zur Berechnung der Werte der Verteilungsfunktion der nichtzentralen t-Verteilung	59
5. Die Eigenschaften des t-Tests	63
6. Untersuchung des Verhaltens der Macht des t-Tests in Abhängigkeit vom Niveau ihrer Be- stimmungsgrößen	76
6.1 Veränderungen des Signifikanzniveaus	76
6.2 Einfluß modellspezifischer Komponenten auf die Macht des t-Tests	78
6.2.1 Methodische Vorgehensweise und Modellwahl	78
6.2.2 Die Einflußgröße $\sigma^2$	81
6.2.3 Die Einflußgröße $s_x^2$	82
6.2.4 Variationen des Stichprobenumfangs	83

	<u>Seite</u>
<u>IV. Zur Frage des Verhaltens des t-Tests gegen- über Zeitreihenproblemen in ökonomischen Modellen</u>	87
1. Der t-Test bei Multikollinearität	87
1.1 Exakte lineare Beziehungen zwischen den Regressoren: Die Prüfung schätzbarer Hypothesen	87
1.2 Stochastische lineare Abhängigkeiten zwischen den exogenen Variablen	91
2. Tests im verallgemeinerten linearen Modell der Normalregression	106
2.1 Begründung, Annahmen und Schätzfunktio- nen des Modells	106
2.2 Die Teststatistiken	114
3. Die Struktur der Monte-Carlo-Experimente	126
3.1 Simulationstechniken und Auswertungs- verfahren	126
3.2 Die Simulationsmodelle	136
4. Heteroskedastizität der normalverteilten Störvariablen	140
4.1 Eine Monte-Carlo-Studie zur Untersu- chung der Robustheit des auf den klassi- schen Schätzfunktionen basierenden t-Tests	140
4.2 Die Macht des t-Tests in den transfor- mierten Modellen	149
5. Autokorrelation der normalverteilten Stör- variablen	153
5.1 Eine Monte-Carlo-Studie zur Untersu- chung der Robustheit des auf den klassi- schen Schätzfunktionen basierenden t-Tests	153
5.2 Die Macht des t-Tests in den autore- gressiv transformierten Modellen	168
5.3 Der t-Test unter Verwendung zweiphasi- ger Schätzungen	176
5.3.1 Die asymptotische Verteilung des t-Verhältnisses	176
5.3.2 Eine Monte-Carlo-Studie zur Unter- suchung der Eigenschaften des Tests bei kleinen Stichproben	180
<u>V. Der t-Test bei nichtnormalverteilten Störva- riablen</u>	197
1. Die asymptotische Verteilung des t-Ver- hältnisses	197
2. Eine Monte-Carlo-Studie zur Untersuchung der Robustheit des t-Tests bei kleinen Stichproben	203

	<u>Seite</u>
Schlußbetrachtung: Zusammenfassung der Ergebnisse und Hinweise auf weitere Forschungsgebiete	224
Anhang I	230
Anhang II	238
Anhang III	267
Anhang IV	276
Literaturverzeichnis	278
Liste der aus der Programmbibliothek des RZ Freiburg entliehenen Programme	283
Stichwortverzeichnis	284