
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 Literatúrauswahl | 7 |

Teil II Daten

| | |
|--|----|
| 2 Datenbasis der empirischen Wirtschaftsforschung | 11 |
| 2.1 Arten von Daten | 17 |
| 2.2 Amtliche Statistik | 19 |
| 2.3 Nicht amtliche Statistik | 23 |
| 2.4 Internationale Statistik | 26 |
| 2.5 Zugang zu verfügbaren Daten | 29 |
| 2.6 Datenqualität | 29 |
| 2.7 Literatúrauswahl | 33 |
| 3 Datenaufbereitung | 35 |
| 3.1 Grafische Darstellung von Daten | 36 |
| 3.2 Einfache Transformationen von Daten | 37 |
| 3.2.1 Quotientenbildung | 37 |
| 3.2.2 Wachstumsraten | 38 |
| 3.2.3 Maßzahlen | 41 |
| 3.2.4 Preisbereinigung | 41 |
| 3.2.5 Elastizitäten | 43 |
| 3.2.6 Inter- und Extrapolation | 44 |

| | | |
|----------|--|------------|
| 3.3 | Einige statistische Kenngrößen | 45 |
| 3.4 | Preis- und Mengenindizes | 50 |
| 3.5 | Saldierung von Tendenzindikatoren | 61 |
| 3.6 | Aggregation von Zeitreihen | 64 |
| 3.7 | Ausreißer und Messfehler | 65 |
| 3.8 | Literaturauswahl | 67 |
| 4 | Wirtschaftsindikatoren | 69 |
| 4.1 | Einteilung von Konjunkturindikatoren | 69 |
| 4.2 | Geschichte des Einsatzes von Konjunkturindikatoren | 73 |
| 4.3 | Stabilitätsgesetz und Indikatoren | 76 |
| 4.3.1 | Indikatoren für das Preisniveau | 77 |
| 4.3.2 | Indikatoren für den Beschäftigungsstand | 78 |
| 4.3.3 | Indikatoren für das außenwirtschaftliche Gleichgewicht | 80 |
| 4.3.4 | Wachstumsindikatoren | 85 |
| 4.3.5 | Verteilungsindikatoren | 87 |
| 4.3.6 | Weitere gesamtwirtschaftliche Indikatoren | 93 |
| 4.4 | Komplexe Indikatoren | 95 |
| 4.4.1 | Gesamtindikatoren aus Umfragedaten | 96 |
| 4.4.2 | Das gesamtwirtschaftliche Produktionspotenzial | 98 |
| 4.5 | Literaturauswahl | 102 |
| 5 | Input-Output-Analyse | 103 |
| 5.1 | Geschichte der Input-Output-Analyse | 104 |
| 5.2 | Die Input-Output-Tabelle | 107 |
| 5.2.1 | Herleitung von Input-Output-Tabellen | 107 |
| 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 |
| 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 | 149 |
| 7.3.2 | Der F -Test | 154 |

| | | |
|----------|---|------------|
| 7.4 | Ein Anwendungsbeispiel | 156 |
| 7.5 | Literaturauswahl | 160 |
| 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 | 183 |
| 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 Variablen | 197 |
| 9.1 | Qualitative erklärende Variablen | 197 |
| 9.1.1 | Dummyvariablen | 198 |
| 9.1.2 | Kategoriale Variablen | 202 |
| 9.1.3 | Interaktion von Dummyvariablen | 206 |
| 9.1.4 | Dummyvariablen und Strukturbruchtest | 209 |
| 9.2 | Abhängige qualitative Variablen | 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 | 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 | 264 |
| 11.3.1 | Zeitreihenmodelle als reduzierte Form | 265 |
| 11.3.2 | ARMA-Prozesse | 266 |
| 11.4 | Literaturauswahl | 266 |
| 12 | Nichtstationarität und Kointegration | 267 |
| 12.1 | Nichtstationarität | 267 |
| 12.1.1 | Deterministische und stochastische Trends | 267 |
| 12.1.2 | Scheinregressionen | 268 |
| 12.1.3 | Kovarianz-Stationarität und I(1)-Prozesse | 270 |
| 12.2 | Unit-Root-Tests | 272 |
| 12.2.1 | Dickey-Fuller-Test | 273 |
| 12.2.2 | Augmented Dickey-Fuller-Test | 275 |
| 12.2.3 | KPSS-Test | 277 |
| 12.2.4 | HEGY-Test | 279 |
| 12.3 | Kointegration | 280 |
| 12.3.1 | Engle-Granger-Verfahren | 281 |
| 12.3.2 | Kointegration im Fehlerkorrekturmodell | 284 |
| 12.4 | Literaturauswahl | 285 |
| 12.5 | Anhang: Kritische Werte für das Engle-Granger-Verfahren | 287 |
| 12.6 | Anhang: Kritische Werte für Fehlerkorrekturtest auf Kointegration | 288 |
| 13 | Diagnose und Prognose | 289 |
| 13.1 | Wozu werden Prognosen benötigt? | 289 |
| 13.2 | Klassifikation von Prognosen | 291 |
| 13.3 | Grenzen des Einsatzes von Prognosen | 292 |
| 13.4 | Konjunkturprognose | 293 |
| 13.4.1 | Diagnose der gegenwärtigen Lage | 295 |
| 13.4.2 | Entwicklung exogener Größen | 296 |
| 13.4.3 | Prognose | 297 |
| 13.5 | Prognose mit ökonometrischen Modellen | 301 |
| 13.6 | Bewertung der Prognosegüte | 304 |
| 13.6.1 | Mittlerer und mittlerer absoluter Prognosefehler | 305 |
| 13.6.2 | Mittlerer quadratischer Prognosefehler | 307 |
| 13.6.3 | Theils Ungleichheitskoeffizient | 308 |
| 13.6.4 | Tests für den Vergleich von Prognosen | 309 |
| 13.6.5 | Bewertung qualitativer Prognosen | 311 |

| | |
|---|------------|
| 13.7 Simulation mit ökonomischen Modellen | 313 |
| 13.7.1 Arten der Simulation | 314 |
| 13.7.2 Prognosemodellselektion | 315 |
| 13.7.3 Politiksimulationen | 316 |
| 13.8 Literaturhinweise | 317 |
| Abbildungsverzeichnis | 319 |
| Tabellenverzeichnis | 323 |
| Verzeichnis der Fallbeispiele | 325 |
| Sachverzeichnis | 327 |
| Literaturverzeichnis | 333 |



<http://www.springer.com/978-3-662-49298-7>

Empirische Wirtschaftsforschung und Ökonometrie

Winker, P.

2017, XIII, 346 S. 89 Abb., Softcover

ISBN: 978-3-662-49298-7