

DIE WIRTSCHAFTSWISSENSCHAFTEN
HERAUSGEBER: PROF. DR. DR. h. c. E. GUTENBERG, KÖLN

DR. GÜNTER MENGES
o. Professor an der Universität des Saarlandes

Ökonometrie



BETRIEBSWIRTSCHAFTLICHER VERLAG DR. TH. GABLER
WIESBADEN

Inhaltsverzeichnis

Erster Teil

Einführung

Erstes Kapitel

Zur Geschichte und zum Wesen der Ökonometrie

1. Zur Geschichte	9
2. Zum Begriff	14
3. Statistik und Ökonometrie	17
4. Die Erkenntnisaufgabe der Ökonometrie	20

Zweites Kapitel

Das begriffliche und methodische Werkzeug

1. Einige Grundbegriffe	26
2. Die Variablen	34
3. Die Gleichungen	38

Drittes Kapitel

Die Aufstellung ökonometrischer Modelle

1. Wozu überhaupt ökonometrische Modelle?	42
2. Die vorbereitenden Phasen	44
3. Das Hypothesenprüfen, Schätzen und Prognostizieren	49
4. Interdependente und rekursive Modelle	50

Zweiter Teil

Theorie

Erstes Kapitel

Das vollständige Modell

1. Die Struktur	57
2. Das ökonometrische Modell	67
3. Die Identifikation	72

Zweites Kapitel

Die Schätzmethoden

1. Die Eigenschaften guter Schätzungen	88
2. Die Methode der kleinsten Quadrate	90
3. Die Methode der Größten Dichte	99

Drittes Kapitel

Die Zuverlässigkeit von Schätzung und Prognose

1. Die Genauigkeit der Schätzungen	110
2. Die Prognose	117
3. Die Theorie der Hypothesenprüfung und Konfidenzzonen	121

Dritter Teil

Technik

Erstes Kapitel

Die Parameterschätzung mit der Methode der kleinsten Quadrate

1. Der Fall einer einfachen Regressionsgleichung	126
2. Der Fall einer multiplen Regressionsgleichung	132
3. Die Korrelationstechnik. Die Büschelkartenanalyse	139

Zweites Kapitel

Die Parameterschätzung mit der Methode der Größten Dichte (Maximum-Likelihood-Method)

1. Die Aufstellung eines Modells	155
2. Die Vorbereitungen für die Schätzung	162
3. Die Schätzung	167
4. Die Schätzung bei „beschränkter Information“	183

Drittes Kapitel

Hypothesenprüfung und Prognose

1. Die Prüfung der Nullhypothese eines Trendkoeffizienten	191
2. Die Prüfung von Hypothesen über Regressions- und Korrelationskoeffizienten	198
3. Die Prognose	206

<i>Anhang: Matrizenrechnung</i>	<i>219</i>
---	------------

<i>Literaturverzeichnis</i>	<i>231</i>
---------------------------------------	------------

<i>Namensregister</i>	<i>243</i>
---------------------------------	------------

<i>Sachregister</i>	<i>245</i>
-------------------------------	------------