

Dietrich Trenkler

Computergestützte Tests  
in Statistik und Ökonometrie

Universitätsverlag Rasch Osnabrück

# Inhaltsverzeichnis

1	Einführung	1
1.1	Der klassische Hypothesentest	1
1.2	Computergestützte Tests	7
1.3	Zusammenfassung und Ausblick	9
2	Grundlagen und Definitionen	13
2.1	Eigenschaften von Tests	13
2.2	Konfidenzintervalle	18
2.3	Computergestützte Tests	22
3	Graphische Verfahren	31
3.1	Einleitung	31
3.2	Theoretischer Quantil-Boxplot, TQBP	32
3.3	Empirischer Quantil-Boxplot, EQBP	42
3.4	Eindimensionaler Signifikanzplot	48
3.5	Zweidimensionaler Signifikanzplot	52
3.6	Zusammenfassung	55
4	Eigenschaften von computergestützten Tests	57
4.1	Einleitung	57
4.2	p-Werte und Eigenschaften von Tests	58
4.3	Gütevergleich computergestützter Tests	67
4.4	Zusammenfassung	74

5	Anpassungstests	77
5.1	Einleitung	77
5.2	Eine Klasse von Anpassungstests	82
5.3	Ein graphischer Ausreißer-Test	96
5.4	Offene Fragen und Ausblick	99
5.5	Zusammenfassung	101
6	Lineares Regressionsmodell	103
6.1	Einleitung	103
6.2	Grundlagen und Notationen	104
6.3	Ausreißertests	108
6.4	Einflußmaße	116
6.5	Tests auf Strukturbruch	128
6.6	Tests auf Autokorrelation	161
7	Nichtparametrische Tests	175
7.1	Einleitung	175
7.2	Iterationstests	176
7.3	Verallgemeinerter Cramer-von Mises-Test	178
7.4	Kendalls Tau in Kontingenztafeln	181
8	Inferenz bei Bernoulli-Verteilung	187
8.1	Einleitung	187
8.2	Eigenschaften von Konfidenzintervallen	188
8.3	Klassische Verfahren	195
8.4	Eine Synthese	198
8.5	Crow-Pläne für Monte-Carlo-Tests	209
8.6	Zusammenfassung	215

9 Fazit und Schlußbetrachtung	217
A Datensätze	225
Literaturverzeichnis	251
Symbolverzeichnis	261