

Gerhard Bauer

Schätzung von  
ökonometrischen  
Ungleichgewichtsmodellen

Empirische Analysen am Beispiel  
von Faktornachfrageentscheidungen



Idstein 1985

INHALTSVERZEICHNIS	1
VERZEICHNIS DER TABELLEN	4
VERZEICHNIS DER ABBILDUNGEN	6
1. EINLEITUNG	7
1.1 Erklärung struktureller Ungleichgewichte durch ökonomische Modelle	13
1.2 Zielsetzung und Aufbau der Arbeit	19
2. ABBILDUNG STRUKTURELLER UNGLEICHGEWICHTE IN MAKRO- ÖKONOMISCHEN MODELLEN	22
2.1 Spezifikation ökonomischer Systeme	22
2.1.1 Aufbau und Funktionsweise	23
2.1.2 Bedeutung der Konsistenz theoretischer Grundlagen	34
2.1.3 Methodische Grundlagen	40
2.2 Mikroökonomische Grundlagen einer simultanen Erklärung der Nachfrage auf Faktormärkten	44
2.2.1 Charakterisierung von Faktormärkten	44
2.2.2 Bausteine von Faktornachfragefunktionen	48
2.2.3 Produktionsfunktion und Nachfragemodell	52
2.2.4 Optimierung des Faktornachfrageniveaus	61
2.2.4.1 Strukturelle Formen eines Faktor- nachfragemodells	63
2.2.4.2 Reduzierte Form eines Faktornach- fragemodells	68
2.2.4.3 Kostenfunktion und reduzierte Form eines Faktornachfragemodells	72
2.2.5 Anpassung der Faktornachfrage an das theoretische Optimum	76
2.3 Die 'Neue Makroökonomie' als theoretische Grund- lage zur Analyse struktureller Ungleichgewichte	83
2.3.1 Grundlinien der Neuen Makroökonomie	84
2.3.2 Ökonomische und ökonomische Modellspezi- fikation eines Güter-Arbeitsmarktmodells	89
2.3.2.1 Modellaufbau und komparativ- statische Analyse	90
2.3.2.2 Ökonomische Formulierung	103

2.3.2.3	'Neue Makroökonomie' und ökonomische Modellspezifikation	109
2.3.3	Besonderheiten in der Struktur ökonomischer Ungleichgewichtsmodelle	112
2.3.3.1	Abbildung von Restriktionen	112
2.3.3.2	Dynamische und statische Modellelemente	117
2.4	Anforderungen an makroökonomische Modellsysteme	122
2.4.1	Simultane Analyse von Märkten	122
2.4.2	Konsistenz der theoretischen Grundlagen	124
2.4.3	Aufgabe der Strukturkonstanzannahme	126
3.	ANSÄTZE ZUR SCHÄTZUNG STRUKTURELLER UNGLEICHGEWICHTE	128
3.1	Problembereiche und grundlegende ökonomische Strukturen von "switching-regression" und Ungleichgewichtsmodellen	131
3.1.1	Stochastische Annahmen	132
3.1.2	Regimezuordnung von Beobachtungswerten	136
3.1.3	Exogene und endogene Preisbestimmung	139
3.2	Modellansätze mit exogenem Switching	141
3.2.1	Stochastische versus deterministische Regimezuordnung	142
3.2.2	Steuervariablenmethoden bei ordinaler Information. Exkurs: Steuervariablenmethode und 'Neue Makroökonomie'	146 149
3.2.3	Glättung der Likelihoodfunktion	152
3.3	Modellansätze mit endogenem Switching	156
3.3.1	Methodische Grundlagen und Schätzprinzipien	157
3.3.2	"Short-side"-Modelle bei exogener Preisbestimmung	160
3.3.3	"Short-side"-Modelle bei endogener Preisbestimmung	166
3.3.3.1	Maximum-Likelihood-Schätzprinzip	169
3.3.3.2	Mehrstufige Kleinst-Quadrat-Methode	170
3.4	Dynamische Ansätze	176
3.4.1	Simultanes partial-adjustment-Modell	177
3.4.2	Zeitliche "spill-over"-Effekte	181

3.5	Mehr-Markt-Ungleichgewichtsmodelle	185
3.5.1	Modellaufbau	186
3.5.2	Schätzprinzipien	189
3.6	Zusammenfassende Würdigung	196
4.	EMPIRISCHE ANALYSE	200
4.1	Zielsetzung und Datenbasis	202
4.2	Methodische Alternativen zur Beschreibung und Erklärung struktureller Ungleichgewichte auf dem Faktormarkt	207
4.2.1	Analyse gesamtwirtschaftlicher Faktornachfragefunktionen	209
4.2.2	Sektorale Disaggregation und Faktornachfragesysteme	223
4.2.3	Regimezugehörigkeit von Faktornachfragefunktionen	235
4.3	Ein Ungleichgewichtsmodell für den Arbeitsmarkt	242
4.3.1	Modellstruktur und Datenbasis	242
4.3.2	Schätzergebnisse	249
4.4	Simulation struktureller Ungleichgewichte am Beispiel eines ökonometrischen Modells für die Bundesrepublik Deutschland	260
4.4.1	Beschreibung der Modellstrukturen	261
4.4.2	Theoretische Grundlagen, Schätzung und Ergebnisse regimespezifischer Verhaltensgleichungen	271
4.4.3	Darstellung und Bewertung der Simulationsergebnisse	285
4.5	Zusammenfassende Überlegungen zur empirischen Analyse	294
5.	SCHLUBBETRACHTUNG	297
	ANHANG	300
	LITERATURVERZEICHNIS	336