

Walter Krämer

Eine Rehabilitation der Gewöhnlichen Kleinst-Quadrate-Methode als Schätzverfahren in der Ökonometrie



HAAG +
HERCHEN
Verlag

Frankfurt am Main

INHALTSVERZEICHNIS

	Seite
1. Einleitung	1
2. Frühere Rehabilitationsversuche	5
3. Simultane Gleichungssysteme	11
a) Modell und Identifikation	11
b) Definition der Schätzverfahren	19
c) Eigenschaften der Schätzverfahren	33
4. Monte Carlo Vergleich einiger Schätzverfahren	45
a) Allgemeines zu Monte Carlo Experimenten	45
b) Frühere Arbeiten	50
c) Eigener Versuchsaufbau	57
d) Qualitätskriterien	65
e) Ergebnisse der ersten Versuchsreihe	71
f) Ein neuer Simulationsansatz	82
5. Zusammenfassung	88
 Anhang: Die gewöhnliche Kleinst-Quadrate-Methode im klassischen Regressionsmodell mit korrelierten Störgrößen	 90
 Literaturverzeichnis	 99