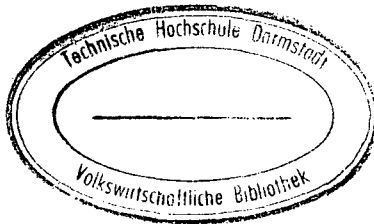


Beiträge zur empirischen Wirtschaftsforschung
Herausgeber:
Rudolf Henn, Manfred Lösch, Diethard Pallaschke, Bernd Schips

Band 3

Bernd Blümel

**Bootstrappen der
Fixpunktschätzfunktionen**
Theorie und Anwendungen



Verlag Rüegger

Inhaltsverzeichnis

0. Einleitung	1
<u>Teil A</u> (Asymptotische Theorie)	
1. Grundlagen	10
2. Reid- bzw. Geid-Schätzung interdependenter Systeme	18
3. Bootstrappen des Reid- bzw. Geid-Schätzers eines statischen interdependenten Systems	24
4. Bootstrappen des Reid- bzw. Geid-Schätzers eines dynamischen interdependenten Systems	33
<u>Teil B</u> (Modellschätzungen)	
1. Das Fixpunktverfahren	60
2. Das Jackknife	62
3. Die klassischen Varianzschätzungen	64
4. Das Modell Klein 1	67
5. Ein 4-Gleichungsmodell	77
6. Ein nichtlineares Modell	82
7. Ein Modell der griechischen Volkswirtschaft	86
<u>Teil C</u> (Zusammenfassung, Literaturverzeichnis)	
1. Zusammenfassung	94
2. Literaturverzeichnis	96

Tabellenverzeichnis

Tabelle 1	Parameterschätzung durch das Fixpunktverfahren. Bootstrapschätzung der Standardabweichung (STB), Jackknifeschätzung der Standardabweichung (STJ), klassische Schätzung der Standardabweichung (STC) (im Modell Klein 1).	71
Tabelle 2	Vergleich der wahren Standardabweichung im Simulationsmodell mit RMSB, RMSJ und RMSC (Modell Klein 1).	74
Tabelle 3	Bootstrapstandardabweichung nach 20, 40, 50, 60, 80 und 100 Neuziehungen (Modell Klein 1).	75
Tabelle 4	Parameterschätzung durch das Fixpunktverfahren. Bootstrapschätzung der Standardabweichung (STB), Jackknifeschätzung der Standardabweichung (STJ), klassische Schätzung der Standardabweichung (STC) im 4-Gleichungsmodell.	78
Tabelle 5	Vergleich der wahren Standardabweichung im Simulationsmodell zum 4-Gleichungsmodell mit RMSB, RMSJ und RMSC.	79
Tabelle 6	Bootstrapstandardabweichung nach 20, 40, 50, 60, 80 und 100 Neuziehungen im 4-Gleichungsmodell.	81
Tabelle 7	Parameterschätzung durch das Fixpunktverfahren. Bootstrapschätzung der Standardabweichung (STB), Jackknifeschätzung der Standardabweichung (STJ) im nicht-linearen Modell.	84

Tabelle 8 Bootstrapstandardabweichung nach
20, 40, 50, 60, 80 und 100 Neu-
ziehungen im 17-Gleichungsmodell.

91