

Identifikations- und Schätzprobleme linearer ökonometrischer Modelle

**unter besonderer Beachtung
der GEID-Spezifikation
und der Fixpunkt-Schätzfunktion**

von

Manfred Lösch

Forschungsgemeinschaft für Nationalökonomie
Hochschule St. Gallen
für Wirtschafts- und Sozialwissenschaften

**Verlagsgruppe
Athenäum/Hain/Scriptor/Hanstein**

Inhaltsverzeichnis

1. Oekonometrische Modelle
 - 1.1 Der Modellansatz der Oekonometrie
 - 1.2 Die Variablen und der Erklärungshorizont ökonomischer Modelle
 - 1.3 Lineare ökonomische Modelle
 - 1.4 Allgemeine Modellannahmen
 - 1.5 Die CLID-Spezifikation ¹⁾
 - 1.6 Die GEID-Spezifikation ²⁾
 - 1.7 Die Struktur ökonomischer Modelle
 2. Das Problem der Identifizierbarkeit und Identifikationskonzepte bei endlichem Stichprobenumfang
 - 2.1 Die Aufgabenstellung ökonomischer Modelle
 - 2.2 Das Entscheidungsmodell der Mathematischen Statistik und seine Darstellung für das lineare ökonomische Modell bei festem Stichprobenumfang T
 - 2.3 Identifikationsproblematik und Identifikationskonzept für lineare ökonomische Modelle bei festem Stichprobenumfang T
 - 2.4 Das Identifikationskonzept von T.J.ROTHENBERG
 3. Ein Identifikationskonzept zur Untersuchung von asymptotischen Eigenschaften von Schätzfunktionen
 - 3.1 Vorbemerkungen
 - 3.2 Das Identifikationskonzept
 - 3.3 Die Frage der Identifizierbarkeit unter dem Aspekt der Existenz konsistenter Folgen von Schätzfunktionen
 4. Kriterien für die Beobachtungsäquivalenz und Identifizierbarkeit in CLID-spezifizierten linearen ökonomischen Modellen
 - 4.1 Kriterium für die Beobachtungsäquivalenz
 - 4.2 Das Rang- und Abzählkriterium
-
- 1) Die Bezeichnung CLID resultiert aus den Abkürzungen der englischen Bezeichnungsweise 'classic interdependent'.
 - 2) Die Bezeichnung GEID resultiert aus den Abkürzungen der englischen Bezeichnungsweise 'generalized interdependent'.

5. Zur Frage der Konsistenz der OLS- 1), TLSLS- 2) und FP- 3) Schätzfunktionen für die Koeffizienten CLID- und GEID-spezifizierter linearer ökonomischer Modelle
- 5.1 Vorbemerkungen
- 5.2 Inkonsistenz der OLS-Schätzfunktionen
- 5.3 Konsistenzeigenschaften der TLSLS-Schätzfunktionen
- 5.4 FP-Schätzfunktionen, Definition und Konsistenzeigenschaften
6. Identifikations- und Schätzproblematik in statischen linearen ökonomischen Modellen unter einer speziellen Normalverteilungshypothese
- 6.1 Die Normalverteilungshypothese
- 6.2 Beobachtungäquivalenz und Identifizierbarkeit im statischen, CLID-spezifizierten Modell unter der Normalverteilungshypothese
- 6.3 Identifikations- und Schätzproblematik der Parameter der unbeschränkten reduzierten Form im statischen, GEID-spezifizierten Modell unter der Normalverteilungshypothese
- 6.4 Kriterien für die lokale Identifizierbarkeit im statischen, GEID-spezifizierten Modell und Folgerungen für die Schätzproblematik der Koeffizientenmatrizen der Strukturform
7. Bedeutung der Ergebnisse für die Anwendung
8. Literaturverzeichnis
9. Verzeichnis der verwendeten Voraussetzungen
10. Symbolverzeichnis