

Michael Leserer

Grundlagen der Ökonometrie



Vandenhoeck & Ruprecht in Göttingen

Inhalt

	Seite
1 Einführung	9
2 Zur Beschreibung ökonomischer Modelle	19
2.1 Modellformen	19
2.2 Das Identifikationsproblem	40
2.3 Zur Unterscheidung alternativer Modellansätze	52
3 Regressionsanalyse I: Grundlagen	58
3.1 Das allgemeine lineare Regressionsmodell	58
3.2 Lineare Hypothesen	85
3.3 Die Stringenz des Beta-Fehlers	96
4 Regressionsanalyse II: Einige ökonomisch bedeutsame Spezialprobleme	102
4.1 Multikollinearität	103
4.2 Inkonsistenz	115
4.3 Parametervariation	126
5 Parameter-Schätzfunktionen in interdependenten Modellen	135
5.1 Reduzierte Form und Kleinste Quadrate	135
5.2 Zweistufige und dreistufige Kleinste-Quadrate-Schätzfunktionen	144
5.3 Maximum-Likelihood-Schätzfunktionen	167
6 Anhang	176
Literatur	189
Stichwortverzeichnis	195