

Verena Dexheimer

Einreisetourismus in Deutschland

Paneldatenanalysen
und SARIMA-Prognosen



PETER LANG
Internationaler Verlag der Wissenschaften

INHALTSVERZEICHNIS

ABKÜRZUNGS- UND SYMBOLVERZEICHNIS	IX
TABELLENVERZEICHNIS	XIV
ABBILDUNGSVERZEICHNIS	XV
1 EINLEITUNG	1
2 ÖKONOMISCHE GRUNDLAGEN	5
2.1 Begriffsdefinitionen	6
2.2 Zeitliche und räumliche Entwicklungen des Einreisemarktes	8
2.3 Wirtschaftliche Bedeutung des deutschen Einreisemarktes	14
2.4 Rahmenbedingungen des deutschen Einreisemarktes	17
2.4.1 Ökonomische Entwicklungen	17
2.4.2 Technischer Fortschritt und Globalisierung	25
2.4.3 Besondere Ereignisse	27
2.4.4 Soziodemographische Änderungen auf der Nachfrageseite	29
2.4.5 Strukturwandel auf der Angebotsseite	32
2.5 Dynamische Effekte der Tourismusknachfrage	34
2.6 Saisonalität im Tourismus	36
3 PANELDATENANALYSEN	39
3.1 Eigenschaften von Paneldatensätzen	39
3.2 Statische Paneldatenmodelle	41
3.2.1 Classical-Pooling-Modell	41
3.2.2 Fixed-Effects-Modell	44
3.2.3 Random-Effects-Modell	47
3.2.4 Annahmeverletzungen in Panelmodellen	50
3.2.5 Auswahl des geeigneten statischen Verfahrens	54
3.2.6 Anpassungsgüte statischer Paneldatenschätzungen	56
3.3 Dynamische Paneldatenmodelle	58
3.3.1 Grundlagen	58
3.3.2 Instrumentvariablen-Ansatz nach Arellano und Bond	60
3.4 Modellierung des deutschen Einreisetourismus	64
3.4.1 Datengrundlage	65
3.4.2 Statische Paneldatenmodelle	74
3.4.3 Dynamisches Paneldatenmodell	84
3.5 Würdigung und Ausblick	90

4	ZEITREIHENANALYTISCHE PROGNOSEN	95
4.1	Saisonaler Box-Jenkins-Ansatz	96
4.1.1	Allgemeine Darstellung des Modells.....	96
4.1.2	Modellidentifikation.....	99
4.1.3	Modellbeurteilung.....	100
4.1.4	Modellvoraussetzung der Stationarität.....	103
4.1.4.1	Formen der Nichtstationarität in Zeitreihen	104
4.1.4.2	Grafische Überprüfungsmöglichkeiten.....	109
4.1.4.3	Tests auf Stationarität	111
4.1.5	Prognosen.....	117
4.2	Zeitreihenanalysen und Prognosen des deutschen Einreisetourismus...	122
4.2.1	Datengrundlage	122
4.2.2	Saisonale Box-Jenkins-Ansätze	123
4.3	Würdigung und Ausblick.....	138
5	SCHLUSSBEMERKUNGEN	142
	ANHANG.....	144
Anhang 1	Kritische Werte des Panel-DW-Tests von Bhargava et al.....	144
Anhang 2	Outputs der statischen Paneldatenmodelle	145
Anhang 3	Korrelationsmatrix der Regressoren.....	147
Anhang 4	Output des FE-AR1-Modells.....	148
Anhang 5	Output des dynamischen Modells.....	149
Anhang 6	Übersicht saisonaler Einheitswurzeln im HEGY/BM-Test.....	151
Anhang 7	Kritische Werte des HEGY/BM-Tests	152
Anhang 8	Kritische Werte des CH-Tests	153
Anhang 9	Zeitreihe ausländischer Gästeankünfte in Deutschland.....	154
Anhang 10	Output der Dummy-Regression auf die erste reguläre Differenz.....	155
Anhang 11	Airline-Modell mit und ohne Ausreißerdummies	156
Anhang 12	AKF der Residuen der identifizierten SARIMA-Modelle	157
Anhang 13	Ex-ante-Prognose des SARIMA-Airline-Modells.....	158
	LITERATUR- UND QUELLENVERZEICHNIS	159