

Inhaltsverzeichnis

	Seite
Verzeichnis der verwendeten Symbole	VI
Verzeichnis der Tabellen	VII
Verzeichnis der Abbildungen	IX
Kapitel 1 Einleitung	1
Kapitel 2 Das Modell	5
2.1 Darstellung	5
2.1.1 Formulierung des Modells als stochastisches Differenzgleichungssystem 1-ter Ordnung	6
2.1.2 Die finale Form des Modells	7
2.2 Modellannahmen	9
2.2.1 Zusammenstellung aller Modellannahmen	9
2.2.2 Einige Folgerungen	11
2.2.3 Stabilität des Modells	11
2.2.3.1 Definition der Stabilität	11
2.2.3.2 Äquivalente Stabilitätsbedingungen	15
2.2.3.3 Einige Bemerkungen zur Rolle der Stabilität in ökonometrischen Modellen	20
2.2.4 Die Momentenmatrizen der vorherbestimmten Variablen	22
2.2.5 Identifikation	24
Kapitel 3 Darstellung der Schätzverfahren	27
3.1 Zweistufige Methode der kleinsten Quadrate (TSLS)	27
3.1.1 Ableitung der Schätzfunktion	27
3.1.2 Statistische Eigenschaften der Schätzfunktion	30
3.1.2.1 Erwartungswert der Schätzfunktion	30
3.1.2.2 Konsistenz der Schätzfunktion	31
3.1.2.3 Asymptotische Verteilung der Schätzfunktion	33
3.2 Maximum-Likelihood-Methode bei beschränkter Information (LISE)	41

	Seite
3.2.1	Ableitung der Schätzfunktion 41
3.2.2	Statistische Eigenschaften der Schätzfunktion 44
3.3	Übereinstimmung der Schätzverfahren für genau identifizierte Gleichungen 45
Kapitel 4	Simulationsplan 47
4.1	Untersuchungsziele 47
4.2	Das zugrundeliegende Modell 48
4.3	Variation der Modellparameter 49
4.3.1	Auswahl der Strukturen von Γ , A_1 und C 49
4.3.2	Festlegung der Werte der Koeffizienten von Γ , A_1 und C 57
4.3.3	Die exogenen Variablen 60
4.3.4	Die Anfangswerte der endogenen Variablen 61
4.3.5	Erzeugung von Zufallsvariablen 61
4.4	Der Versuchsplan 62
Kapitel 5	Versuchsrealisation 64
5.1	Simulationsablauf 64
5.2	Beurteilungskriterien 65
5.2.1	Kriterien zur Beurteilung der Schätzfunktion $\hat{\beta}$ 65
5.2.2	Kriterien zur Beurteilung der Schätzfunktion $\hat{\delta}$ 66
5.2	Algorithmen 70
5.2.1	Berechnung der Parameterschätzwerte nach LISE 70
5.2.2	Erzeugung der Zufallszahlen 73
5.3	Numerische Probleme 74
5.3.1	Probleme der Maschinengenauigkeit 75
5.3.2	Schlecht konditionierte Matrizen 77
Kapitel 6	Versuchsauswertung 79
6.1	Verfahren 79
6.2	Die Schätzung des Spektralradius 86
6.2.1	Darstellung der Ergebnisse 86
6.2.2	Diskussion der Ergebnisse 102

	Seite
6.3 Die Schätzung der Strukturform	106
6.3.1 Die erste Gleichung - Darstellung und Diskussion der Ergebnisse -	106
6.3.2 Die zweite Gleichung - Darstellung und Diskussion der Ergebnisse -	122
6.3.3 Die dritte Gleichung - Darstellung und Diskussion der Ergebnisse -	132
6.3.4 Vergleich der Ergebnisse für die einzelnen Gleichungen	139
Kapitel 7 Zusammenfassung	142
Anhang A Zwei Sätze zur Verteilungskonvergenz	145
Anhang B Der zentrale Grenzwertsatz für m-abhängige Variablen	148
Literaturverzeichnis	173
Autorenregister	178
Sachregister	179