



Peter Hackl

Einführung in die Ökonometrie

2., aktualisierte Auflage

PEARSON

Higher Education

München • Harlow • Amsterdam • Madrid • Boston
San Francisco • Don Mills • Mexico City • Sydney

a part of Pearson plc worldwide

Inhaltsübersicht

Vorwort		17
Kapitel 1	Einführung	21
Teil I	Lineare Regressionsmodelle	27
Kapitel 2	Das klassische Regressionsmodell	29
Kapitel 3	Lineare Regression: Schätzverfahren	47
Kapitel 4	Annahmen des lineären Regressionsmodells	61
Kapitel 5	Statistische Bewertung von Regressionsbeziehungen	73
Kapitel 6	Variablenauswahl und Missspezifikation	97
Kapitel 7	Lineare Restriktionen	119
Kapitel 8	Prognose und Prognosequalität	137
Teil II	Methodische Erweiterungen	149
Kapitel 9	Analyse der Modellstruktur	151
Kapitel 10	Multikollinearität	173
Kapitel 11	Heteroskedastizität	187
Kapitel 12	Autokorrelation	205
Kapitel 13	Zeitreihen und Zeitreihen-Modelle	229
Kapitel 14	Trends und Unit-root-Tests	247
Kapitel 15	Instrumentvariablen-Schätzung	269
Teil III	Modellierung in der Ökonometrie	283
Kapitel 16	Ökonometrische Modelle	285
Kapitel 17	Dynamische Modelle: Konzepte	295
Kapitel 18	Dynamische Modelle: Schätzen der Parameter	317

Kapitel 19	Kointegration	333
Kapitel 20	Mehrgleichungs-Modelle: Konzepte	345
Kapitel 21	Mehrgleichungs-Modelle: Schätzverfahren	367
Kapitel 22	VAR-Prozesse und VEC-Modelle	387
Teil IV	Anhang	403
Anhang A	Das Area-Wide-Modell	405
Anhang B	Datensätze	411
Anhang C	Wahrscheinlichkeitsverteilungen	417
Anhang D	Statistik	429
Anhang E	Matrixalgebra	445
Anhang F	Ökonometrische Software: gretl und EViews	461
Anhang G	Tabellen	489
Literatur		493
Sachregister		497