

# Studies in Contemporary Economics

---

## *Editorial Board*

H. Bester

B. Felderer

H.J. Ramser

K. W. Rothschild



Werner Gaab · Ullrich Heilemann  
Jürgen Wolters (Hrsg.)

---

# Arbeiten mit ökonometrischen Modellen

Mit 47 Abbildungen und 16 Tabellen

**Springer-Verlag Berlin Heidelberg GmbH**

Professor Dr. Werner Gaab  
Universität Duisburg-Essen  
Standort Essen  
Fachbereich Makroökonomik  
Universitätsstraße 12  
45117 Essen  
werner.gaab@uni-essen.de

Professor Dr. Ullrich Heilemann  
Rheinisch-Westfälisches Institut  
für Wirtschaftsforschung  
Hohenzollernstraße 1–3  
45128 Essen  
heil@rwi-essen.de

Professor Dr. Jürgen Wolters  
Freie Universität Berlin  
Institut für Statistik und Ökonometrie  
Boltzmannstraße 20  
14195 Berlin  
wolters@wiwiss.fu-berlin.de

Universität Duisburg-Essen  
Standort Duisburg  
Lehrgebiet Volkswirtschaftslehre  
insb. Empirische Wirtschaftsforschung  
Lotharstraße 56  
47057 Duisburg

ISBN 978-3-7908-0154-5      ISBN 978-3-7908-2652-4 (eBook)  
DOI 10.1007/978-3-7908-2652-4

Bibliografische Information Der Deutschen Bibliothek  
Die Deutsche Bibliothek verzeichnet diese Publikation in der Deutschen Nationalbibliografie; detaillierte bibliografische Daten sind im Internet über <http://dnb.ddb.de> abrufbar.

Dieses Werk ist urheberrechtlich geschützt. Die dadurch begründeten Rechte, insbesondere die der Übersetzung, des Nachdrucks, des Vortrags, der Entnahme von Abbildungen und Tabellen, der Funksendung, der Mikroverfilmung oder der Vervielfältigung auf anderen Wegen und der Speicherung in Datenverarbeitungsanlagen, bleiben, auch bei nur auszugsweiser Verwertung, vorbehalten. Eine Vervielfältigung dieses Werkes oder von Teilen dieses Werkes ist auch im Einzelfall nur in den Grenzen der gesetzlichen Bestimmungen des Urheberrechtsgesetzes der Bundesrepublik Deutschland vom 9. September 1965 in der jeweils geltenden Fassung zulässig. Sie ist grundsätzlich vergütungspflichtig. Zuwiderhandlungen unterliegen den Strafbestimmungen des Urheberrechtsgesetzes.

springer.de

© Springer-Verlag Berlin Heidelberg 2004

Ursprünglich erschienen bei Physica-Verlag Heidelberg 2004

Die Wiedergabe von Gebrauchsnamen, Handelsnamen, Warenbezeichnungen usw. in diesem Werk berechtigt auch ohne besondere Kennzeichnung nicht zu der Annahme, dass solche Namen im Sinne der Warenzeichen- und Markenschutz-Gesetzgebung als frei zu betrachten wären und daher von jedermann benutzt werden dürften.

Umschlaggestaltung: Erich Kirchner, Heidelberg

SPIN 10973998

88/3130-5 4 3 2 1 0 – Gedruckt auf säurefreiem Papier

# Inhaltsverzeichnis

<b>Einleitung</b> .....	<b>1</b>
Werner Gaab, Ullrich Heilemann, Jürgen Wolters	
<b>Das klassische lineare Einzelgleichungsregressionsmodell</b> .....	<b>7</b>
Walter Assenmacher	
<b>Dynamische Regressionsmodelle</b> .....	<b>47</b>
Jürgen Wolters	
<b>Leitfaden zum Testen und Schätzen von Kointegration</b> .....	<b>85</b>
Uwe Hassler	
<b>Simultane ökonometrische Modelle: Struktur, Schätzung und Evaluation</b> .....	<b>117</b>
Werner Gaab	
<b>Das RWI-Konjunkturmodell – Ein Überblick</b> .....	<b>161</b>
Ullrich Heilemann	
<b>Simulation mit makroökonomischen Modellen</b> .....	<b>213</b>
Ullrich Heilemann, Sandra M. Renn	
<b>The Logical Structure of a Model</b> .....	<b>233</b>
Manfred Gilli	
<b>Analyzing the Simulation Properties of a Macroeconometric Model by Estimating Its Implicit AD-AS Structure</b> .....	<b>259</b>
Bert G. Hickman	