



## Übung zur Empirischen Wirtschaftsforschung

### Übungsblatt VI - Ökonometrische Testverfahren

#### **Aufgabe 1**

Führen Sie im Workfile EW\_ue8.wf1 folgende Schätzung durch (ab 1960:1):

$$\ln(\text{konsumw})_t = c + \alpha_1 \text{seas}(1)_t + \alpha_2 \text{seas}(2)_t + \alpha_3 \text{seas}(3)_t + \beta \ln(\text{yvw})_t$$

Zu welchen Aussagen kommen Sie hinsichtlich der Signifikanz der geschätzten Koeffizienten? Wie bewerten sie den Wert des korrigierten Bestimmtheitsmaßes? Wie interpretieren sie den Koeffizienten von  $\ln(\text{yvw})$ ?

#### **Aufgabe 2**

Testen Sie anhand des Chow-Testes, ob es zum Zeitpunkt der Deutschen Wiedervereinigung (1990:4) einen Strukturbruch im westdeutschen Konsumverhalten gegeben hat. Welche Variante des Chow-Tests ist für diese Fragestellung geeignet?

#### **Aufgabe 3**

Prüfen Sie anhand des Breusch-Godfrey-Tests, ob für diese Schätzung das Problem der Autokorrelation vorliegt. Gehen Sie von 12 Lags aus. Wie lautet die Nullhypothese? Welches Ergebnis liefert der Test?

#### **Aufgabe 4**

Führen sie einen White-Test ohne *White cross terms* durch. Wie lautet die Nullhypothese? Welches Ergebnis liefert der Test?