



Übung zur empirischen Wirtschaftsforschung

Übungsblatt 3

Der (späteste) Abgabetermin für die kompletten Studienarbeiten ist Mittwoch, der 13. Juli, bis 12 Uhr. Der Gesamtumfang soll 10 Seiten nicht übersteigen, die Abgabe kann (und soll) zu zweit geschehen.

Aufgabe 1

Arbeiten Sie den ersten Teil Ihrer Studienarbeit weiter aus. Nehmen Sie, falls bisher noch nicht vorhanden, einen Abschnitt über Datenherkunft und Datenbeschreibung auf. Treffen Sie bewertende Aussagen über Ihr bisheriges Modell und überarbeiten Sie ggf. die Spezifikation. Interpretieren Sie die Koeffizienten.

Aufgabe 2

Zu welchen Zeitpunkten würden Sie aufgrund wirtschaftsgeschichtlicher Ereignisse Strukturbrüche vermuten? Testen Sie anhand des Chow-Testes, ob es zum jeweiligen Zeitpunkt einen Strukturbruch gegeben hat. Falls Strukturbrüche vorhanden sind: Was sind die Nachteile einer Schätzung über einen Strukturbruch hinweg? Gibt es Gründe eine Schätzung über den gesamten Zeitraum dennoch mehreren Schätzungen über kleinere Zeiträume vorzuziehen?

Aufgabe 3

Vermuten Sie Autokorrelation in Ihrem Modell, und wenn ja von welcher Ordnung? Prüfen Sie anhand des Breusch-Godfrey-Tests, ob für das von Ihnen präferierte Modell das Problem der Autokorrelation vorliegt. Wie lautet die Nullhypothese? Gibt es andere Möglichkeiten das Modell auf Autokorrelation zu überprüfen?

Aufgabe 4

Führen Sie einen White-Test ohne White cross terms durch. Wie lautet die Nullhypothese? Welches Ergebnis liefert der Test? Hat dies Auswirkungen auf die Genauigkeit ihrer Prognose?

Aufgabe 5

Gehen Sie im Schlussteil Ihrer Arbeit kurz auf die Problematik der Unsicherheit von Prognosen ein!