

Zusatz: Autokorrelation

Was ist Autokorrelation?

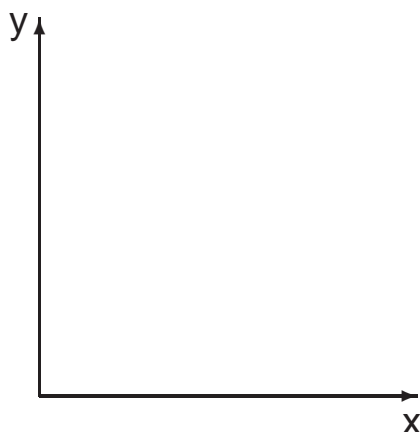
- Anforderung an die Residuen:
- Bei Autokorrelation:
- Die Beobachtungen weisen eine Systematik auf, die nicht durch die exogenen Variablen erfasst wird

⇒

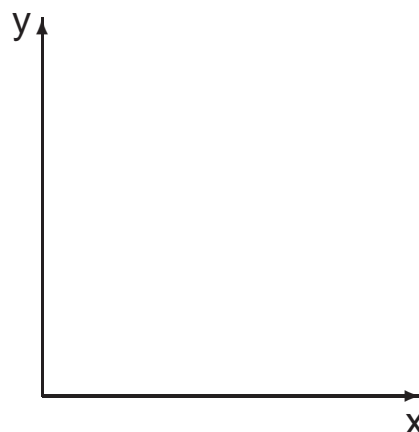
Erinnerung:

- unabhängig: kein Störterm hat einen Einfluss auf einen anderen
- identisch: alle Störterme besitzen die selbe Verteilung (μ und σ^2 sind konstant)

- z.B. wenn:



ohne Autokorrelation



mit Autokorrelation

Wie kommt es zur Autokorrelation?

- Auswirkung von bestimmten Ereignissen:
 - z.B. Naturkatastrophen, Wirtschaftskrisen, Börsencrash
 - Auswirkungen auf mehrere Perioden mit abnehmender Intensität
 - wenn keine Daten über das Ereignis vorliegen, sie also nicht beobachtbar sind, ist der Einfluss in den Störtermen enthalten. Die Störterme weisen also einen systematischen Einfluss auf.
- Fehlspezifikationen:
 - i) falscher Funktionsterm
wenn der wahre Zusammenhang ein log-linearer ist, aber eine lineare Funktion geschätzt wird
 - ii) fehlende Variable:
wahres Modell :
geschätztes Modell:

Konsequenzen

- Schätzer der Koeffizienten:
 -
 -
 -
- Standardfehler:
 -
 - ⇒
 -
 -
 -