

Empirische Wirtschaftsforschung

Grundlagen - Methoden - Beispiele

Bearbeitet von
Prof. Dr. Robert Galata, Prof. Dr. Markus Wessler, Dr. Sandro Scheid, Rita Augustin

1. Auflage 2013 2013. Taschenbuch. 242 S. Paperback
ISBN 978 3 446 43227 7
Format (B x L): 16,7 x 24,2 cm
Gewicht: 465 g

Weitere Fachgebiete > Philosophie, Wissenschaftstheorie, Informationswissenschaft >
Forschungsmethodik, Wissenschaftliche Ausstattung

Zu Leseprobe

schnell und portofrei erhältlich bei

The logo for beck-shop.de features the text 'beck-shop.de' in a bold, red, sans-serif font. Above the 'i' in 'shop' are three red dots of increasing size. Below the main text, 'DIE FACHBUCHHANDLUNG' is written in a smaller, red, all-caps, sans-serif font.

beck-shop.de
DIE FACHBUCHHANDLUNG

Die Online-Fachbuchhandlung beck-shop.de ist spezialisiert auf Fachbücher, insbesondere Recht, Steuern und Wirtschaft. Im Sortiment finden Sie alle Medien (Bücher, Zeitschriften, CDs, eBooks, etc.) aller Verlage. Ergänzt wird das Programm durch Services wie Neuerscheinungsdienst oder Zusammenstellungen von Büchern zu Sonderpreisen. Der Shop führt mehr als 8 Millionen Produkte.



Inhaltsverzeichnis

Robert Galata, Markus Wessler, Sandro Scheid, Rita Augustin

Empirische Wirtschaftsforschung

Grundlagen, Methoden, Beispiele

Herausgegeben von Robert Galata, Markus Wessler

ISBN (Buch): 978-3-446-43227-7

ISBN (E-Book): 978-3-446-43783-8

Weitere Informationen oder Bestellungen unter

<http://www.hanser-fachbuch.de/978-3-446-43227-7>

sowie im Buchhandel.

Inhalt

1	Einführung	11
2	Regressionsanalyse	15
2.1	Lineare Einfachregression	16
2.1.1	Das klassische lineare Regressionsmodell	16
2.1.2	Schätzen der Modellparameter	19
2.1.3	Korrelationskoeffizient und Bestimmtheitsmaß	24
2.1.4	Stochastische Eigenschaften der KQ-Schätzer	28
2.1.5	Konfidenzintervalle und Tests	31
2.1.6	Prognose	37
2.2	Multiple lineare Regression	44
2.2.1	Das multiple lineare Regressionsmodell	44
2.2.2	Schätzen der Modellparameter	48
2.2.3	Streuungszerlegung und Bestimmtheitsmaß	52
2.2.4	Stochastische Eigenschaften der KQ-Schätzer	54
2.2.5	Konfidenzintervalle und Tests	57
2.2.6	Prognose	62
3	Varianzanalyse	65
3.1	Die einfaktorielle Varianzanalyse mit festen Effekten	65
3.1.1	Modell	66
3.1.2	Statistische Inferenz	68
3.1.3	Multiple Mittelwertvergleiche	81
3.1.4	Verletzung der Modellannahmen	85
3.2	Einfaktorielle Varianzanalyse mit zufälligen Effekten	90
3.2.1	Modell	90
3.2.2	Statistische Inferenz	91
3.3	Die einfaktorielle Varianzanalyse mit Blockfaktor	95
3.3.1	Modell	96
3.3.2	Statistische Inferenz	97
3.4	Die zweifaktorielle Varianzanalyse mit festen Effekten	104

3.4.1	Modell	105
3.4.2	Statistische Inferenz	107
3.5	Ausblick: Weitere Versuchspläne	116

4	Logit-Modell	118
4.1	Generalisierte lineare Modelle	118
4.2	Einführung in das logistische Regressionsmodell	118
4.3	Interpretation des Logit-Modells	120
4.4	Schätzung des Modells	127
4.4.1	ML-Schätzung	128
4.4.2	Maximierung der Likelihood	129
4.4.3	Schätzen des Logit-Modells	132
4.4.3.1	Likelihood im Logit-Modell	132
4.4.3.2	Scorefunktion des Logit-Modells	132
4.4.3.3	Beobachtete Informationsmatrix des Logit-Modells	134
4.4.3.4	Erwartete Informationsmatrix des Logit-Modells	134
4.4.4	Skizze zur ML-Schätzung	135
4.5	Asymptotische Eigenschaften des ML-Schätzers	139
4.6	Asymptotische Konfidenzintervalle für einzelne Koeffizienten	140
4.7	Asymptotisches Testen einzelner Koeffizienten	141
4.8	Asymptotisches Testen linearer Hypothesen	144
4.9	Vergleich von Modellen	148
4.10	Güte der Anpassung	150
4.11	Ausblick	151

5	Diskriminanzanalyse	152
5.1	Einführende Beispiele	152
5.1.1	Klassifizierung anhand eines Merkmals in zwei Gruppen	152
5.1.2	Klassifizierung anhand zweier Merkmale in zwei Gruppen	154
5.2	Beschreibung der Datensituation und der Problemstellung	161
5.3	Lineare Diskriminanzanalyse	161
5.3.1	Aufgabenstellung	162
5.3.2	Lösung des Maximierungsproblems	163
5.3.3	Verallgemeinertes Eigenwertproblem	164
5.3.4	Zusammenfassung und Illustration an einem Beispiel	165
5.3.5	Güte der Diskriminanzfunktion	170
5.3.6	Zuordnungsvorschrift mithilfe kanonischer Variablen	172
5.4	Klassische Diskriminanzanalyse bei Vorliegen einer Normalverteilung	174

5.5	Quadratische Diskriminanzanalyse bei Vorliegen einer Normalverteilung	178
5.6	Bayesianische Diskriminanzanalyse bei Vorliegen einer Normalverteilung	182
5.6.1	Berücksichtigung von a-priori-Wahrscheinlichkeiten	182
5.6.2	Berücksichtigung von Kosten für Fehlklassifikationen	185
5.7	Ausblick	188

6 Faktorenanalyse189

6.1	Grundlagen	189
6.1.1	Einige Zerlegungen	190
6.1.2	Abgrenzung Hauptkomponentenanalyse und Hauptachsenanalyse	196
6.1.3	Theoretische Vorbereitung: Eigenwerte	199
6.2	Hauptkomponentenanalyse und Dekomposition	206
6.2.1	Der Zusammenhang mit Eigenwerten	207
6.2.2	Allgemeines Vorgehen	211
6.2.3	Ein Praxisbeispiel	214
6.3	Rotation	215
6.3.1	Einfachstruktur und Rotation	216
6.3.2	Die Rotation am Beispiel	219
6.4	Hauptkomponentenanalyse mit SPSS	222
6.4.1	Noch einmal das Beispiel 6.1	222
6.4.2	Zwei Erweiterungen des Beispiels 6.1	224

A Tabellen230

A.1	Standardnormalverteilung	230
A.2	χ^2 -Verteilung	232
A.3	t -Verteilung	233
A.4	F -Verteilung	234
A.5	Verteilung der studentisierten Spannweite	237
A.6	Kritische Werte für den Test von Dunnett	239

Literatur240

Sachwortverzeichnis241