

GLIEDERUNG ZUR VORLESUNG
"METHODEN DER WIRTSCHAFTSPROGNOSE"
Wintersemester 2007/2008

| | |
|---|-----------|
| 1 Einführung | 1 |
| 1.1 Begriffe | 1 |
| 1.2 Prognosearten | 1 |
| 2 Wichtige Prognoseverfahren | 2 |
| 2.1 Befragungen | 2 |
| 2.1.1 Expertenbefragungen | 2 |
| 2.1.2 Massenbefragungen | 2 |
| 2.2 Indikator-Ansätze | 4 |
| 2.2.1 Grundlagen | 4 |
| 2.2.2 Einzelindikatoren | 4 |
| 2.2.3 Gesamtindikatoren | 5 |
| 2.3 Zeitreihen-Komponentenmodelle | 6 |
| 2.3.1 Grundlagen | 6 |
| 2.3.2 Zeitreihen mit Trends | 9 |
| 2.3.2.1 Lineare Trendmodelle | 9 |
| 2.3.2.2 Nichtlineare Trendmodelle | 11 |
| 2.3.3 Zeitreihen mit Saisonkomponenten | 15 |
| 2.4 Stochastische Zeitreihenmodelle | 20 |
| 2.4.1 Grundlagen | 20 |
| 2.4.2 Box-Jenkins-Modelle | 25 |
| 2.4.2.1 Identifikation | 25 |
| 2.4.2.2 Schätzung | 32 |
| 2.4.2.3 Beurteilung | 32 |
| 2.4.2.4 Prognose | 33 |
| 2.4.2.5 Beispiel | 34 |
| 2.4.3 Erweiterungen | 37 |
| 2.5 Kointegrationsmodelle | 39 |
| 2.5.1 Unechte Regressionen (Spurious Regressions) | 39 |
| 2.5.2 Trend- und differenzstationäre Prozesse | 39 |
| 2.5.3 Dickey-Fuller-Test (ADF-Test) | 40 |
| 2.5.4 Kointegration in Einzelgleichungen | 44 |
| 2.5.5 Fehlerkorrektur-Modelle | 45 |
| 2.6 Input-Output-Analyse | 47 |
| 3 Beurteilungskriterien | 51 |
| 3.1 Grundlagen | 51 |
| 3.2 Quantitative Fehlermaße | 51 |
| 3.3 Qualitative Fehlermaße | 54 |

LITERATUR

- Diebold, F.X. (2007) Elements of Forecasting
4th ed.
Cincinnati (Oh.) (Thomson Learning)
- Makridakis, S. / Wheelwright, S.C./
Hyndman, R.J. (1998) Forecasting. Methods and Applications
3rd ed.
New York usw. (Wiley)
- Newbold, P. / Bos, Th. (1994) Introductory Business & Economic
Forecasting
2nd ed.
Cincinnati (Oh.) (South-Western Publ.)
- Als Ergänzung:**
- Enders, W. (2004) Applied Econometric Time Series
2nd ed.
Hoboken (NJ) (Wiley)
- Mertens, P. / Rässler, S. (Hrsg.) (2005) Prognoserechnung
6. völlig neu bearb. u. erw. Auflg.,
Heidelberg (Physica)
- Rinne, H. / Specht, K. (2002) Zeitreihen. Statistische Modellierung,
Schätzung und Prognose
München (Vahlen)
- Stier, W. (2001) Methoden der Zeitreihenanalyse
Berlin usw. (Springer)