

Inhaltsverzeichnis

	Verzeichnis der wichtigsten Abkürzungen	VII
	Mathematische Symbole	VIII
1	Einführung	1
1.1	Analytische und experimentelle FSR	1
1.2	Relevanz und aktueller Stand der FSR	4
1.3	Ziele und Aufbau dieser Arbeit	8
2	Modellbeschreibung und statistische Grundlagen	10
2.1	Modellspezifikation	10
2.2	Die Wishartverteilung	16
2.3	Folgerungen aus der Modellspezifikation	20
3	LS-Schätzung	22
3.1	Strukturvariante bei unabhängigen Meßfehlern	23
3.1.1	Exakte Dichtefunktion	23
3.1.2	Exakter Erwartungswert, exakter MSE und exakte Varianz	26
3.2	Funktionalvariante bei unabhängigen Meßfehlern	29
3.2.1	Exakte Dichtefunktion	29
3.2.2	Exakter Erwartungswert	38
3.2.3	Exakter MSE und exakte Varianz	43
3.3	Abhängige Meßfehler	47
4	Modifizierte LS-Schätzungen und analytische FSR-Ergebnisse	52
4.1	Modifizierte LS-Schätzungen (CLS-Schätzungen)	53
4.1.1	ACLS-Schätzungen	53
4.1.2	FCLS-Schätzungen	56
4.2	Analytische FSR-Ergebnisse für CLS-Schätzungen	61
4.2.1	Exakte Varianz und exakter MSE zweier CLS-Schätzungen	61
4.2.2	MSE-Vergleich mit der LS-Schätzung	63

5	Eine Monte-Carlo-Studie	70
5.1	Design der Studie	70
5.1.1	Vorüberlegungen	70
5.1.2	Parameterspezifikation und Gütekriterien	72
5.2	Simulationsergebnisse	76
5.2.1	Nichtpartitionierte Schätzungen	76
5.2.2	Partitionierte Schätzungen	84
5.3	Ein Beispiel aus der Agrarökonomie	90
6	Zusammenfassung und Ausblick	95
	Anhang 1: Tabellen zur MC-Studie	101
	Anhang 2: Einzelne Beweise	107
	Tabellen- und Abbildungsverzeichnis	117
	Literaturverzeichnis	119
	Stichwortregister	125