

Potsdamer Schriften zu Statistik und Wirtschaft | 1
Hans Gerhard Strohe (Hrsg.)

Marcus Ruge

Stimmungen und Erwartungen im System der Märkte

Eine Analyse mit DPLS-Modellen

B 379907

Universitätsverlag Potsdam

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	1
2	Statistische Methoden	5
2.1	Übersicht der statistischen Methoden	5
2.2	Partial Least Squares (PLS).....	10
2.2.1	PLS Grundlagen	10
2.2.2	PLS-Modellstruktur.....	21
2.2.3	PLS-Schätzverfahren	26
2.2.4	Reflektive und formative Latente Variable	36
2.2.5	Modellbewertung und Testverfahren	42
2.3	Dynamic Partial Least Squares (DPLS)	53
2.3.1	DPLS-Modellstruktur	53
2.3.2	DPLS-Schätzverfahren	57
2.3.3	Erweiterte DPLS-Modellstruktur	61
2.3.4	Erweitertes DPLS-Schätzverfahren	65
2.3.5	Erweiterte DPLS-Software	69
2.4	Verwandte statistische Methoden	72
2.5	Zusammenfassung.....	79
3	Datenanalyse	81
3.1	Datenübersicht	81
3.2	Stimmungen und Erwartungen	85

4	Wirtschaftstheoretische Aspekte	97
4.1	Stimmungen, Erwartungen und der Homo oeconomicus	97
4.2	Rationale und irrationale Erwartungen	102
4.3	Verwandte ökonometrische Studien	114
4.4	Zusammenfassung	118
5	Statistische Modelle	121
5.1	Übersicht	121
5.2	Modelle der Stimmungen	124
5.2.1	Gütermarkt	124
5.2.2	Kapitalmarkt	130
5.2.3	Geldmarkt	136
5.2.4	Arbeitsmarkt	142
5.2.5	PLS-Gesamtmodell Stimmungen	148
5.2.6	DPLS-Modelle Stimmungen	152
5.2.7	Rationalität der Stimmungen	161
5.2.8	Internationaler Vergleich	167
5.3	Modelle der Erwartungen	170
5.3.1	Prognose Erwartungen und Stimmungen	170
5.3.2	Prognose der wirtschaftlichen Entwicklung	174
5.3.3	Rationalität der Erwartungen	184
5.4	Kausalitäten	190
5.5	Zusammenfassung	196
6	Fazit	199
	Anhang	205
	Literaturverzeichnis	241