

Beispiele zu Kointegration

Kapitel 19

Angewandte Ökonometrie / Ökonometrie III
Michael Hauser

Übungsbeispiele

▶ B19.1 (Hackl 19.A.1: 1)

Sie unterstellen folgende langfristige Beziehung zwischen privatem Konsum und disponiblen Einkommen. $PCR = \mu_1 + \mu_2 PYR$. Die Daten dazu sind in `awm.wf1`.

a) Stellen Sie die beiden Reihen PCR und PYR in einem Graphen dar.

b) Überprüfen Sie, ob sie die gleiche Integrationsordnung besitzen,

c) ob sie kointegriert sind.

d) Schätzen Sie die obige langfristige Konsumgleichung. Stellen Sie den Verlauf der Residuen graphisch dar. Überprüfen Sie deren Korrelogramm. Vergleichen Sie mit dem Ergebnis von c).

▶ B19.2 (Hackl 19.A.1: 2)

Führen Sie die gleiche Untersuchung wie in B19.1 für die Variablen CR und YDR in `dat_s01.wf1` durch.

Übungsbeispiele: B19.3, B19.4

- ▶ B19.3 (Hackl 19.A.1: 4)
Geben zu B19.1 die Fehlerkorrekturdarstellung an und schätzen Sie diese.
- ▶ B19.4
Interpretieren Sie den Output des EViews-Skripts
`spurious_regression2.prg`.
Benutzer der Studentenversion von EViews verwenden
`spurious_regression1_SV.txt`.
Lesen Sie dort die Anweisungen.