

# Studies in Contemporary Economics

---

Gholamreza Nakhaeizadeh

## Neuklassische und Keynesianische Modelle

Theoretische Analyse  
und empirischer Vergleich



Springer-Verlag  
Berlin Heidelberg New York  
London Paris Tokyo

## **Editorial Board**

D. Bös G. Bombach B. Gahlen K. W. Gahlen

## **Autor**

PD Dr. Gholamreza Nakhaeizadeh  
Institut für Statistik und Mathematische Wirtschaftstheorie  
Universität Karlsruhe  
Kaiserstraße 12, D-7500 Karlsruhe 1

ISBN-13: 978-3-540-51311-7

e-ISBN-13: 978-3-642-74845-5

DOI: 10.1007/978-3-642-74845-5

Dieses Werk ist urheberrechtlich geschützt. Die dadurch begründeten Rechte, insbesondere die der Übersetzung, des Nachdrucks, des Vortrags, der Entnahme von Abbildungen und Tabellen, der Funksendung, der Mikroverfilmung oder der Vervielfältigung auf anderen Wegen und der Speicherung in Datenverarbeitungsanlagen, bleiben, auch bei nur auszugsweiser Verwertung, vorbehalten. Eine Vervielfältigung dieses Werkes oder von Teilen dieses Werkes ist auch im Einzelfall nur in den Grenzen der gesetzlichen Bestimmungen des Urheberrechtsgesetzes der Bundesrepublik Deutschland vom 9. September 1965 in der Fassung vom 24. Juni 1985 zulässig. Sie ist grundsätzlich vergütungspflichtig. Zuwiderhandlung unterliegt den Strafbestimmungen des Urheberrechtsgesetzes.

© by Springer-Verlag Berlin Heidelberg 1989

**MEINEN ELTERN**

## **INHALTSVERZEICHNIS**

<b>1. PROBLEMSTELLUNG UND ÜBERSICHT</b>	<b>1</b>
<b>2. DIE HERAUSFORDERUNG DER NEUKLASSISCHEN MAKROÖKONOMIE</b>	<b>6</b>
2.1 Allgemeine Bemerkungen	6
2.2 Theoretische Aspekte der neuklassischen Ökonomie	8
2.2.1 Grundsätze der neuklassischen Theorie	8
2.2.2 Die Erwartungsbildung in der Ökonomie	10
2.2.3 Neutralität des Geldes, natürliche Arbeitslosenquote und die Phillips-Kurve unter Einbeziehung der Erwartungen	17
2.3 Wirtschaftspolitische Aspekte neuklassischer Theorie	20
2.4 Kritische Würdigung der neuklassischen Makroökonomie	22
<b>Anmerkungen zu Kapitel 2</b>	<b>30</b>
<b>Anhang zu Kapitel 2</b>	<b>33</b>
<b>3. VERGLEICH KEYNESIANISCHER UND NEUKLASSISCHER MAKROMODELLE</b>	<b>38</b>
3.1. Einleitung und Problemstellung	38
3.2 Die neuklassischen und keynesianischen makroökonomischen Modelle	41
3.2.1 Allgemeine Bemerkungen	41
3.2.2 Die erste Version eines neuklassischen Modells	42
3.2.3 Die zweite Version eines neuklassischen Modells	46
3.2.4 Die keynesianische Alternative	47
3.3 Schätzung der Modelle	50
3.3.1 Schätzung der ersten Version des neuklassischen Modells (NK-I)	50
3.3.2 Nichtlineares Schätzverfahren für NK-I	54
3.3.3 Analyse der Schätzergebnisse der ersten Version des neuklassischen Modells (NK-I)	57

3.3.4	Schätzung der zweiten Version des neuklassischen Modells (NK-II )	58
3.3.5	Nichtlineares Schätzverfahren für NK-II	68
3.3.6	Analyse der Schätzergebnisse der zweiten Version des neuklassischen Modells (NK-II)	73
3.3.7	Schätzung der keynesianischen Alternative (KA)	75
3.3.8	Analyse der Schätzergebnisse der keynesianischen Alternative	84
3.4	Das Vergleichsverfahren	85
3.4.1	Allgemeine Bemerkungen	85
3.4.2	Die Anpassungskriterien	87
3.4.3	Vergleichsergebnisse unter Verwendung der Anpassungskriterien	89
3.4.4	Anwendung des Cox-Tests	93
3.4.5	Vergleichsergebnisse unter Verwendung des Cox-Pesaran-Verfahrens	94
3.4.6	Anwendung des J-Tests von Davidson und MacKinnon und die Testergebnisse	98
3.4.7	Die Ergebnisse der Anwendung eines klassischen F-Tests	102
3.4.8	Analyse der Vergleichsergebnisse	107
	<b>Anhang zu Kapitel 3</b>	110
A3.1	Einleitung	110
A3.2	Die Anpassungskriterien	113
A3.2.1	Das korrigierte Bestimmtheitsmaß	113
A3.2.2	Der Ansatz von Amemiya (PC)	115
A3.2.3	Die Informationskriterien: Der Ansatz von Akaike	118
A3.3	Anwendung des Cox-Tests zum Vergleich ökonomischer NN-Modelle	120
A3.3.1	Allgemeine Bemerkungen	120
A3.3.2	Das Verfahren von Pesaran	121
A3.3.3	Der J-Test	126
A3.4	Über die Geldmengendefinition und die relevante Geldmenge	128
A3.5	Zur Berechnung des natürlichen Niveaus des Outputs und der Arbeitslosenquote	131

<b>4. VERGLEICH ALTERNATIVER MODELLE FÜR EINE OFFENE VOLKSWIRTSCHAFT</b>	135
4.1 Allgemeine Bemerkungen	135
4.2 Rivalisierende Makromodelle für eine offene ökonomie	137
4.2.1 Die erste Version eines neuklassischen Modells	137
4.2.2 Die zweite Version eines neuklassischen Modells	137
4.2.3 Die keynesianische Alternative für eine offene ökonomie	138
4.3 Schätzung erweiterter Versionen rivalisierender Modelle	139
4.3.1 Allgemeine Bemerkungen	139
4.3.2 Analyse der Schätzergebnisse des ONK-I	154
4.3.3 Analyse der Schätzergebnisse des ONK-II und der OKA	154
4.4 Vergleich rivalisierender Modelle im Fall einer offenen Ökonomie	156
4.4.1 Allgemeine Bemerkungen	156
4.4.2 Analyse der Vergleichsergebnisse rivalisierender Modelle	181
4.5 Zusammenfassung	187
<b>5. ERWARTUNGSBILDUNG UND ALTERNATIVE KONSUMTHEORIEN</b>	188
5.1 Einleitung und Problemstellung	188
5.1.1 Allgemeine Bemerkungen	188
5.1.2 Konsumfunktion und Erwartungsbildungshypothesen	189
5.2 Kritische Würdigung einiger relevanter Arbeiten	191
5.3 Exogenitätstest im Konsum-Einkommen-Prozeß	194
5.4 Statistische Verfahren	194
5.4.1 Statistische Verfahren zum Exogenitätstest	194
5.4.2 Statistische Verfahren der Überprüfung der PEH unter der Annahme rationaler Erwartungen	195
5.4.3 Statistische Verfahren zur Überprüfung der PEH unter Anwendung des adaptiven Ansatzes	202

5.5	Empirische Ergebnisse und ihre Interpretation	204
5.5.1	A-posteriori-Größen der Parameter unter der Annahme rationaler Erwartungen	204
5.5.2	Vergleich verschiedener Erwartungshypothesen innerhalb der PEH	206
5.6	Zusammenfassung und Schlußfolgerungen	207
	<b>Anhang zu Kapitel 5</b>	211
A5.1	Einleitung und Problemstellung	211
A5.2	Granger- und Sims-Verfahren	215
A5.2.1	Granger-Verfahren	215
A5.2.2	Sims-Verfahren	217
A5.3	Bildung und Schätzung der Regressionsmodelle	219
A5.3.1	Die zu schätzenden Modelle innerhalb der Granger- und Sims-Verfahren	219
A5.3.2	Berechnung der statistischen Prüfmaße	222
A5.3.3	Schätzung unter Verwendung der verallgemeinerten KQ-Methode	223
A5.4	Die empirischen Ergebnisse und ihre Analyse	224
A5.4.1	Ergebnisse des Granger-Verfahrens	224
A5.4.2	Ergebnisse des Sims-Verfahrens	227
A5.4.3	Einfluß der Länge von Lags auf den Kausalitätstest	232
A5.4.4	Abschließende Bemerkungen	232
6.	<b>ZUSAMMENFASSUNG UND ABSCHLIEBENDE WÜRDIGUNG</b>	236
	<b>Datenanhang und Definition der Variablen</b>	239
	<b>Literaturverzeichnis</b>	241