

Literaturverzeichnis

- Athukorala, P. und Menon, J. (1995). Exchange rates and strategic pricing: The case of swedish machinery exports, *Oxford Bulletin of Economics and Statistics* **57**, S. 533–546.
- Bache, I. W. (2002). Empirical modelling of norwegian import prices, *Working Paper 2002/1*, Norges Bank, Oslo.
- Beyer, A., Doornik, J. A. und Hendry, D. F. (2000). Reconstructing historical euro-zone data, *Journal of Common Market Studies* **38**, S. 613–624.
- Bodo, G., Golinelli, R. und Parigi, G. (2000). Forecasting industrial production in the euro area, *Empirical Economics* **38**, S. 541–561.
- Boylan, T. A., Cuddy, M. P. und O’Muircheartaigh, I. (1980). The functional form of the aggregate import demand function, *Journal of International Economics* **10**, S. 561–566.
- Burgess, D. F. (1974a). A cost minimization approach to import demand equations, *The Review of Economics and Statistics* **56**(2), S. 225–234.
- Burgess, D. F. (1974b). Production theory and the derived demand for imports, *Journal of International Economics* **4**, S. 103–117.

- Clostermann, J. (1996). Der Einfluß des Wechselkurses auf die deutsche Handelsbilanz, *Diskussionspapier der Volkswirtschaftlichen Forschungsgruppe der Deutschen Bundesbank* 7, Deutsche Bundesbank.
- Clostermann, J. (1998). Folgt der deutsche Außenhandelsbilanzsaldo einer J-Kurve?, *Allgemeines Statistisches Archiv* **82**, S. 198–219.
- Deutsche Bundesbank (1985). Neuberechnung des Außenwerts der D-Mark und fremder Währungen, *Deutsche Bundesbank Monatsbericht* S. 40–47.
- Deutsche Bundesbank (1989). Aktualisierung der Außenwertberechnungen für die D-Mark und fremde Währungen, *Deutsche Bundesbank Monatsbericht* S. 44–52.
- Deutsche Bundesbank (1997). Wechselkurs und Außenhandel, *Deutsche Bundesbank Monatsbericht* S. 43–62.
- Deutsche Bundesbank (1998a). Aktualisierung der Außenwertberechnung und Anpassung an die Bedingungen der Europäischen Währungsunion, *Deutsche Bundesbank Monatsbericht* S. 57–71.
- Deutsche Bundesbank (1998b). Wechselkursabhängigkeit des deutschen Außenhandels – Perspektiven unter den Bedingungen der Europäischen Währungsunion, *Deutsche Bundesbank Monatsbericht* S. 49–59.
- Deutsche Bundesbank (1998c). Zur Indikatorqualität unterschiedlicher Konzepte des realen Außenwerts der D-Mark, *Deutsche Bundesbank Monatsbericht* S. 41–55.
- Dickey, D. A. und Fuller, W. A. (1979). Distribution of the estimators for autoregressive time series with a unit root, *Journal of the American Statistical Association* **74**(366), S. 427–431.
- Diebold, F. X. und Mariano, R. S. (1995). Comparing predictive accuracy, *Journal of Business and Economic Statistics* **13**, S. 253–263.

- Doornik, J. A. (1999). Approximations to the asymptotic distributions of cointegration tests, In: L. Oxley und M. McAleer (Hrsg.), *Practical Issues in Cointegration Analysis*, Blackwell, Oxford, Kapitel 6, S. 157–177.
- Döpke, J. und Fischer, M. (1994). Was bestimmt die westdeutschen Exporte?, *Die Weltwirtschaft* (1), S. 54–66.
- Dreger, C. und Schumacher, C. (1999). Die empirische Umsetzung der makroökonomischen Produktionstheorie - Möglichkeiten und Grenzen, *Technical Report 92*, Institut für Wirtschaftsforschung Halle.
- Enders, W. (2004). *Applied Econometric Time Series*, 2. Auflage, J. Wiley, New York.
- Engle, R. F. und Granger, C. W. J. (1987). Cointegration and error correction: Representation, estimation and testing, *Econometrica* **55**(2), S. 251–276.
- Fischer, M. (1995). Was bestimmt die westdeutschen Importe?, *Die Weltwirtschaft* (4), S. 431–443.
- Fuller, W. A. (1976). *Introduction to Statistical Time Series*, John Wiley, New York.
- Goldberg, P. K. und Knetter, M. M. (1996). Goods prices and exchange rates: What have we learned?, *Working Paper 5862*, National Bureau of Economic Research, Cambridge.
- Goldstein, M. und Khan, M. S. (1985). Income and price effects in foreign trade, In: Jones R. W. und P. B. Kenen (Hrsg.), *Handbook of International Economics, Vol. II*, Elsevier Science Publishers B.V., Kapitel 20, S. 1041–1105.
- Goldstein, M., Khan, M. S. und Officer, L. H. (1980). Prices of tradable and nontradable goods in the demand for total imports, *The Review of Economics and Statistics* **62**(2), S. 190–199.
- Griffith, W. E., Hill, R. C. und Judge, G. G. (1993). *Learning and Practicing Econometrics*, J. Wiley, New York.

- Harris, R. I. D. (1995). *Using Cointegration Analysis in Econometric Modelling*, Prentice Hall, London.
- Hassler, U. (2000). *Regression trendbehafteter Zeitreihen in der Ökonometrie*, Akademische Abhandlungen zur Statistik, Verlag für Wissenschaft und Forschung, Berlin.
- Hassler, U. (2004). Leitfaden zum Testen und Schätzen von Kointegration, In: W. Gaab, U. Heilemann und J. Wolters (Hrsg.), *Arbeiten mit ökonometrischen Modellen*, Physica-Verlag, Heidelberg, S. 85–115.
- Hassler, U. und Wolters, J. (2006). Autoregressive distributed lag models and cointegration, *Allgemeines Statistisches Archiv* . Im Erscheinen.
- Helkie, W. und Hooper, P. (1988). The U.S. external deficit in the 1980s: An empirical analysis, In: R. Bryant, G. Holtham und P. Hooper (Hrsg.), *External Deficits and the Dollar: The Pit and the Pendulum*, Brookings Institution, Washington D.C.
- Houthakker, H. S. und Magee, S. P. (1969). Income and price elasticities in world trade, *The Review of Economics and Statistics* **51**(2), S. 111–125.
- Jarchow, H.-J. und Rühmann, P. (1991). *Monetäre Außenwirtschaft. I. Monetäre Außenwirtschaftstheorie*, 3. Auflage, Vandenhoeck und Ruprecht, Göttingen.
- Johansen, S. (1995). *Likelihood-Based Inference in Cointegrated Vector Autoregressive Models*, Oxford University Press, Oxford.
- Ketelsen, U. und Kortelainen, M. (1996). The pass-through of exchange rate changes to import prices, *Discussion Paper 26/96*, Bank of Finland.
- Khan, M. S. und Ross, K. Z. (1975). Cyclical and secular elasticities of the demand for imports, *The Review of Economics and Statistics* **57**(3), S. 357–361.
- Khan, M. S. und Ross, K. Z. (1977). The functional form of the aggregate import demand equation, *Journal of International Economics* **7**, S. 149–160.

- Kohli, U. (1985). U.S. imports by origin: A system approach, *Weltwirtschaftliches Archiv* **121**, S. 741–755.
- Kohli, U. (1988). U.S. imports by origin: A characteristic approach, *Kyklos* **41**, S. 51–74.
- Kohli, U. (1991). *Technology, Duality, and Foreign Trade: The GNP Function Approach to Modeling Imports and Exports*, Studies in International Trade Policy, The University of Michigan Press, Ann Arbor.
- Krugman, P. (1986). Pricing to market when the exchange rate changes, *Working Papers 1926*, NBER.
- Lapp, S., Scheide, J. und Solveen, R. (1995). Determinants of exports in the G7-countries, *Kiel Working Paper 707*, The Kiel Institute of World Economics.
- Leamer, E. E. und Stern, R. M. (1970). *Quantitative International Economics*, Allyn and Bacon, Boston.
- MacKinnon, J. G. (1991). Critical values for co-integration tests, In: R. F. Engle und C. W. J. Granger (Hrsg.), *Long-Run Economic Relationships*, Oxford University Press, Oxford, S. 267–276.
- Magee, S. P. (1975). Prices, incomes, and foreign trade, In: P. B. Kenen (Hrsg.), *International Trade and Finance: Frontiers for Research*, Cambridge University Press, Cambridge, S. 175–252.
- Marquez, J. (2002). *Estimating Trade Elasticities*, Band 39 der *Advanced Studies in Theoretical and Applied Econometrics*, Kluwer Academic Publishers, Boston.
- Meacci, M. und Turner, D. (2001). Modelling import responsiveness for OECD manufactures trade, *Economics Department Working Papers 311*, OECD.
- Meier, C.-P. (1998). *Reale Wechselkurse und internationale Wettbewerbsfähigkeit: Eine empirische Analyse der Wirkungen von Wechselkursschwankungen*

- auf die Bundesrepublik Deutschland*, Untersuchungen zur Wirtschaftspolitik, Institut für Wirtschaftspolitik, Köln.
- Menon, J. (1996). The degree and the determinants of exchange rate pass-through: Market structure, non-tariff barriers and multinational corporations, *The Economic Journal* **106**, S. 434–444.
- Meurers, M. (2003). *Angebot und Nachfrage im Außenhandel – Theoretische Überlegungen und eine Kointegrationsanalyse für Deutschland*, Band 13 der *Ifo Beiträge zur Wirtschaftsforschung*, ifo Institut für Wirtschaftsforschung, München.
- Murray, T. und Ginman, P. J. (1976). An empirical examination of the traditional aggregate import demand model, *The Review of Economics and Statistics* **58**(1), S. 75–80.
- Naug, B. und Nymoer, R. (1996). Pricing to market in a small open economy, *Scandinavian Journal of Economics* **98**(3), S. 329–350.
- Nelson, C. R. und Plosser, C. I. (1982). Trends and random walks in macroeconomic time series: Some evidence and implications, *Journal of Monetary Economics* **10**, S. 139–162.
- Orcutt, G. H. (1950). Measurement of price elasticities in international trade, *The Review of Economics and Statistics* **32**(2), S. 117–132.
- Osterwald-Lenum, M. (1992). A note with quantiles of the asymptotic distribution of the maximum likelihood cointegration rank test statistics, *Oxford Bulletin of Economics and Statistics* **54**, S. 461–472.
- Perron, P. (1989). The great crash, the oil price shock, and the unit root hypothesis, *Econometrica* **57**, S. 1361–1401.
- Perron, P. und Vogelsang, T. J. (1993). Erratum, *Econometrica* **61**(1), S. 248f.
- Rietzler, K. (2003). A flash estimate of euro area GDP. Unpublished manuscript.

- Rose, K. und Sauernheimer, K. (1992). *Theorie der Außenwirtschaft*, 11. Auflage, Vahlen, München.
- Sandermann, G. (1975). *Die Zahlungsbilanz der Bundesrepublik Deutschland 1960-1970 – Eine theoretische und ökonometrische Studie*, Anton Hain, Meisenheim am Glan.
- Sawyer, W. C. und Sprinkle, R. L. (1999). *The Demand for Exports and Imports in the World Economy*, Ashgate, Aldershot.
- Schaudwet, C. und Burgmaier, S. (2005). Keine Wahl, *Wirtschaftswoche vom 17.2.2005*, S. 33ff.
- Seifert, M. (2000). Die Spezifikation des außenwirtschaftlichen Sektors unter den Bedingungen der Währungsunion. www.wiwi.uni-halle.de/wiwi/eni/vw/oekonom/iwh2000/aussen.pdf.
- Senhadji, A. (1998). Time-series estimation of structural import demand equations: A cross-country analysis, *IMF Staff Papers* **45**(2), S. 236–268.
- Stephan, S. (2004). Forecasting german exports to the euro area – a model comparison, *Diskussionsbeiträge des Fachbereichs Wirtschaftswissenschaft der Freien Universität Berlin (Volkswirtschaftliche Reihe) 2004/25*, Berlin.
- Strauß, H. (2000). Eingleichungsmodelle zur Prognose des deutschen Außenhandels, *Kiel Working Paper 987*, The Kiel Institute of World Economics.
- Strauß, H. (2002). Multivariate cointegration analysis of aggregate exports: Empirical evidence for the United States, Canada, and Germany, *Kiel Working Paper 1101*, The Kiel Institute of World Economics.
- Strauß, H. (2003). Globalisierung und die Prognose des deutschen Außenhandels, *Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik* **223**(2), S. 176–203.
- Thursby, J. und Thursby, M. (1984). How reliable are simple, single equation specifications of import demand?, *The Review of Economics and Statistics* **66**(1), S. 120–128.

- Warmedinger, T. (2004). Import prices and pricing-to-market effects in the euro area, *Working Paper 299*, European Central Bank, Frankfurt.
- Warner, D. und Kreinin, M. E. (1983). Determinants of international trade flows, *The Review of Economics and Statistics* **65**(1), S. 96–104.
- Wolters, J. und Hassler, U. (2006). Unit root testing, *Allgemeines Statistisches Archiv* . Im Erscheinen.

Tabellenverzeichnis

4.1	Literaturüberblick: Einkommens- und Preiselastizitäten westdeutscher Importe	22
4.2	Literaturüberblick: Einkommens- und Preiselastizitäten deutscher Importe	23
4.3	Einkommens- und Preiselastizitäten der Importnachfrage in Abhängigkeit vom Beobachtungszeitraum	30
4.4	Prognosegüte der Importfunktionen	51
5.1	Literaturüberblick: Einkommens- und Preiselastizitäten deutscher Exporte	56
5.2	Prognosegüte der Exportfunktionen	68
5.3	Diebold-Mariano-Test für die In-sample-Prognose	69
5.4	Diebold-Mariano-Test für die Out-of-sample-Prognose	70
8.1	Regionale Entwicklung der deutschen Einfuhren (Spezialhandel)	94
8.2	Regionale Entwicklung der deutschen Ausfuhren (Spezialhandel)	95
8.3	Haupteinfuhr- und Hauptausfuhr Güter, 2003	97
8.4	Einheitswurzeltests für den Zeitraum 1975:1-1995:4	101
8.5	Einheitswurzeltests für den Zeitraum 1975:1-2003:4	102
8.6	Ergebnisse des Johansen Kointegrationstests I, (1975:1-1995:4)	103
8.7	Ergebnisse des Johansen Kointegrationstests I, (1975:1-2003:4)	103
8.8	Ergebnisse des Johansen Kointegrationstests IIa, (1975:1-2003:4)	104

8.9	Ergebnisse des Johansen Kointegrationstests IIb, (1975:1-2003:4)	. 104
8.10	Ergebnisse des Johansen Kointegrationstests III, (1975:1-1995:4)	. 105
8.11	Ergebnisse des Johansen Kointegrationstests III, (1975:1-2003:4)	. 106
8.12	Anteile der Hauptgruppen an der gesamten Wareneinfuhr	107
8.13	Einheitswurzeltests für den Zeitraum 1980:1-2003:2	114
8.14	Ergebnisse des Johansen Kointegrationstests I, (1980:1-2003:2)	. . 115
8.15	Ergebnisse des Johansen Kointegrationstests II, (1980:1-2003:2)	. 116
8.16	Einheitswurzeltests für den Zeitraum 1980:1-2004:3	122
8.17	Exportpreis: Fehlerkorrekturterm und Trace Test, (1980:1-2004:3)	123
8.18	Importpreis: Fehlerkorrekturterm und Trace Test, (1980:1-2004:3)	124

Abbildungsverzeichnis

2.1	Regionale Entwicklung des deutschen Außenhandels	7
4.1	Out-of-sample-Prognose der Einfuhr für die Jahre 1996:1-2003:4 (Spezifikation: Clostermann)	29
4.2	Out-of-sample-Prognose der Einfuhr für die Jahre 1996:1-2003:4 (Spezifikation: Stephan)	45
8.1	Relative Importpreise (in logs), (1975:1-2003:4)	99
8.2	Deutsche VGR-Zeitreihen (in logs), (1975:1-2003:4)	100
8.3	Deutsche Exporte und ausländische Aktivitätsvariablen (in logs), (1980:1-2003:2)	112
8.4	Reale Außenwerte und Handelsintensität (in logs), (1980:1-2003:2)	113
8.5	Deutsche Preisindizes und Ölpreis (in logs), (1980:1-2004:3)	120
8.6	Ausländische Preisindizes und Auftragseingänge aus dem Ausland (in logs), (1980:1-2004:3)	121

Abkürzungsverzeichnis

ADF	Augmented Dickey-Fuller(-Test)
AIC	Akaike Informationskriterium
ARCH	Autoregressive Conditional Heteroskedasticity
ARIMA	Autoregressive Integrated Moving Average
BIP	Bruttoinlandsprodukt
cif	cost, insurance, freight
CPI	Consumer Price Index
DF	Dickey-Fuller(-Test)
DIW	Deutsches Institut für Wirtschaftsforschung
EWU	Europäische Wirtschafts- und Währungsunion
EGFKM	Einzelgleichungs-Fehlerkorrekturmodell
ESVG	Europäisches System Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen
FKM	Fehlerkorrekturmodell
fob	free on board
HEGY	Hylleberg-Engle-Granger-Yoo(-Test)
GDP	Gross Domestic Product
GNP	Gross National Product
IMF	International Monetary Fund
KPSS	Kwiatkowski-Phillips-Schmidt-Shin(-Test)
NIESR	National Institute of Economic and Social Research

OECD	Organization for Economic Cooperation and Development
OLS	Ordinary Least Squares
PPI	Producer Price Index
PTM	Pricing to market
RMSE	Root Mean Squared Error
SUR	Seemingly Unrelated Regressions
VECM	Vector Error Correction Model
VAR	Vector Autoregression
VGR	Volkswirtschaftliche Gesamtrechnung

ERKLÄRUNG GEM. §7 ABSATZ 2 DER PROMOTIONSORDNUNG DES
FACHBEREICHES WIRTSCHAFTSWISSENSCHAFT VOM 27. JANUAR 1993

Hiermit erkläre ich, dass ich für meine Dissertation folgende Hilfsmittel und Hilfen verwendet habe:

- EViews 4.0
- PcGive 9.10 und 10.0
- Excel 2000
- Excel-Makro für den Diebold-Mariano-Test, das am National Institute of Economic and Social Research (NEISR) erstellt wurde
- Eviews Programme für die Evaluierung der Prognosegüte, die von Florian Zinsmeister und Serhiy Yahnych erstellt wurden
- Eviews Programm für die Residuenanalyse, das von Camille Logeay erstellt wurde
- sowie die im Abschnitt Literaturverzeichnis angegebene Literatur.

Auf dieser Grundlage habe ich die Arbeit selbständig verfasst.