

# IAB-Colloquium zur Arbeitsmarkt- und Berufsforschung

## Prognose von Preisniveaus für deutsche Kreise

Professor Harry Haupt & Christian Heinze

*Lehrstuhl für Ökonometrie und Statistik, Universität Bielefeld*

Wir prognostizieren Verbraucherpreisindizes für 439 (dies entspricht der von November 2001 bis Juni 2007 verwendeten Klassifikation) deutsche Landkreise für die Jahre 1993 bis 2005. Die Prognosen stellen auf den räumlichen Vergleich des Preisniveaus ab. Als Datenbasis dienen Preisindizes (Ströhl, 1994) für 50 deutsche Städte für das Jahr 1993 und die regelmäßig als Inflationsindikator publizierten Verbraucherpreisindizes für Deutschland (Statistisches Bundesamt, 2011) sowie für ausgewählte Bundesländer. Als Kovariaten dienen die regionale Bruttowertschöpfung, Arbeitslosenquoten und Bevölkerungsdichte. Eine geeignete Modellierung dieser Daten erlaubt das Prognoseproblem im Rahmen eines dynamischen linearen Modells zu behandeln. Letzteres berücksichtigt unter anderem die Struktur der den publizierten Indizes zugrunde liegenden Preiserhebungen, vgl. Pfeffermann (1991). Die vorgestellten Prognosen wurden auf Basis der (im Modellrahmen) optimalen (im Sinne des mittleren quadratischen Vorhersagefehlers) Prognosevorschrift berechnet, vgl. Heinze (2012). Für die dazugehörigen Prognosefehlervarianzen wurde ebenfalls auf die Modellstruktur zurückgegriffen.

**Donnerstag, 31. Mai 2012**

13:00 Uhr

Sitzungssaal 126a