



Sommersemester

Vorlesung

Empirische Wirtschaftsforschung

In der Vorlesung werden grundlegende ökonometrische Modellansätze mit den zugehörigen statistischen Methoden behandelt und deren Eigenschaften analysiert. Schätzverfahren werden für lineare und einige nichtlineare Regressionsmodelle dargestellt. Ein Schwerpunkt wird dabei auf Vorgehensweisen zur adäquaten Spezifikation eines Schätzansatzes gelegt. Es werden die Auswirkungen verschiedener Problemfelder auf die Schätzung behandelt, Diagnosemöglichkeiten und Tests vorgestellt sowie Hinweise zur Problembhebung gegeben. Ebenfalls wird auf Besonderheiten qualitativer Daten und Zeitreihendaten eingegangen.

Der Kurs baut auf den Inhalten der Statistikvorlesungen auf und benötigt darüber hinaus Grundkenntnisse in Vektor- und Matrixalgebra. Im Übungsteil erfolgt eine Einführung in das kostenlos verfügbare Statistikprogramm R, mit dessen Hilfe die in der Vorlesung behandelten Verfahren anhand verschiedener Datensätze erprobt werden.

Gliederung:

1. Einführung
2. Lineare Regression (OLS)
3. Schätzeigenschaften
4. Modellspezifikation
5. Verallgemeinerte lineare Regression (GLS)
6. Zeitreihenanalyse – Einführung
7. Mikroökonometrie – Einführung
8. Nichtlineare Regression (NLS)

Vorkenntnisse: Statistik I und II, Matrixalgebra

Materialien:

- Folien und Übungsblätter auf Moodle
- Literatur:
 - Greene, W.H. (2007), Econometric Analysis, 6. Auflage, New Jersey: Prentice Hall.*
 - Heij, C., De Boer, P., Franses, P.H., Kloek, T., van Dijk, H.K. (2004), Econometric Methods with Applications in Business and Economics, Oxford: Oxford University Press.*
 - Wooldridge, J.M. (2000), Introductory Econometrics: A Modern Approach, South-Western College Publishing.*
 - [oder jedes andere matrixorientierte Ökonometrielehrbuch]
- Übungsbuch:
 - Hübler, O., Tsertsvadze, G. (2007), Übungsbuch zur empirischen Wirtschaftsforschung, München/Wien: Oldenbourg.*
- Software: R-Homepage (<http://cran.r-project.org>)

Zeit und Ort: Aktuelle Angaben finden Sie auf der Fachgebietshomepage und in TUCaN.