



Wintersemester

Vorlesung

Methoden der empirischen Wirtschaftsforschung

Die Vorlesung Methoden der empirischen Wirtschaftsforschung vertieft und erweitert die Inhalte der Bachelor-Vorlesung Empirische Wirtschaftsforschung. Aufbauend auf Wiederholungen und Ergänzungen der mathematischen und statistischen Grundlagen werden theoretische Eigenschaften linearer Regressions-schätzungen diskutiert. Danach erfolgt eine Darstellung der Maximum-Likelihood-Methode und deren Anwendung auf lineare und nichtlineare Regressionsmodelle. In diesem Rahmen wird auch die verallgemeinerte Regressions-schätzung nichtlinearer Modelle behandelt. Eine weitere wichtige Schätzmethode in der Ökonometrie, die Instrumentvariablenschätzung, wird in verschiedenen Formen dargestellt. Dies fließt in die Behandlung der verallgemeinerten Momentenmethode und die Präsentation verschiedener Anwendungen dieses Verfahrens ein. Abgerundet wird die Vorlesung durch die Erläuterung der Grundprinzipien nichtparametrischer Regressionsverfahren.

Gliederung:

1. Matrixalgebra und statistische Grundlagen
2. Lineare Regression (Vertiefung)
3. Maximum-Likelihood-Schätzung (ML)
4. Nichtlineare Regressions-schätzung
5. Instrumentvariablenschätzung
6. Verallgemeinerte Momentenschätzung (GMM)
7. Nichtparametrische Regression

Vorkenntnisse: Grundkenntnisse der Statistik und der linearen Regressionsanalyse (z.B. aus Empirische Wirtschaftsforschung)

Materialien:

- Folien und Übungsaufgaben auf Moodle
- Literatur:
 - Davidson, R., MacKinnon, J.G. (2004), Econometric Theory and Methods, Oxford: Oxford University Press.*
 - Fox, J. (2002), An R and S-PLUS Companion to Applied Regression, London: Sage.
 - Greene, W.H. (2007), Econometric Analysis, 6. Aufl., 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.
- Software: R-Homepage (<http://cran.r-project.org>)

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