



Sommersemester

Vorlesung Mikroökometrie

In der Vorlesung Mikroökometrie werden spezielle Verfahren der Regressionsanalyse für verschiedene Datensituationen vorgestellt. Basis dieser Verfahren ist die Spezifikation einer geeigneten Verteilung und die Parameterschätzung mit der Maximum-Likelihood-Methode. Behandelt werden Logit- und Probit-Modelle für diskrete abhängige Variablen, Poisson- und Negbin-Modelle für Zähldaten sowie Modelle für gestutzte und zensierte abhängige Variablen. Zudem werden Einführungen in Selektionsmodelle, Verweildauermodelle und die Quantilsregression gegeben. Eine kurze Einführung in die Probleme der Regression mit Paneldaten wird ebenfalls gegeben. R-Implementierungen der Verfahren werden vorgestellt und auf Beispieldatensätze angewandt.

Gliederung:

1. Einführung und Grundbegriffe
2. Maximum-Likelihood-Schätzung
3. Diskrete Auswahlmodelle (binär, multinomial, geordnet)
4. Zähldatenmodelle
5. Beschränkt abhängige Variablen
6. Selektionsmodelle
7. Verweildauermodelle (Cox-Regression)
8. Quantilsregression
9. Paneldatenregression

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

Materialien:

- Folien und Übungsaufgaben auf Moodle
- Literatur:
 - Cameron, A.C., Trivedi, P.K. (2005), Microeconometrics: Methods and Applications, Cambridge (Mass.): Cambridge University Press.
 - Franses, P.H., Paap, R. (2001), Quantitative Models in Marketing Research, Cambridge (Mass.): Cambridge University Press.
 - 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.
 - Wooldridge, J.M. (2002), Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, Cambridge (Mass.): MIT Press.
- Software: R-Homepage (<http://cran.r-project.org>)

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