

## Master-Veranstaltung Ökonometrie (5 ECTS)

für Master Arbeitsmarkt und Personal: Quantitative Methoden 1

für Master Sozialökonomik: Ökonometrie 1

für Master in FACT: Ökonometrie 1

für Master in Management: Ökonometrie 1

für Master in Marketing: Statistik II – Ökonometrie

für Master in Gesundheitsmanagement und -ökonomie

Vorlesung: findet im Sommersemester nicht statt

Übung: Mittwoch 08.00-09.30 Uhr ab 25.04.2022

(Tafelübung: LG 5.155 und PC-Übung: CIP Pool LG 0.421)

Tutorien: Angebot ab 27.06.22, Teilnahme freiwillig, weitere Informationen folgen.

Sprechstunde: Mittwoch 15.00-16.00 Uhr, nach der Veranstaltung und nach Vereinbarung.

Die Veranstaltung setzt solide Vorkenntnisse der Statistik und idealerweise der empirischen Wirtschaftsforschung voraus. Sie vermittelt Grundkenntnisse der Ökonometrie in Verbindung mit einer Einführung in die Statistiksoftware Stata. Die Studierenden lernen lineare und nichtlineare Schätz- und Testverfahren mit ihren statistischen Eigenschaften kennen und wenden diese an. Die Methoden werden an Beispielen ausführlich erläutert. Im Rahmen der Übung wird der Stoff wiederholt und mit Hilfe der Statistiksoftware Stata angewendet. In einer freiwillig zu erstellenden empirischen Hausarbeit führen die Studierenden eigene Untersuchungen durch. Dies soll die Fähigkeit vermitteln, selbständig mit Daten umzugehen, und die Kompetenz stärken, empirische Studien kritisch zu hinterfragen.

Gliederung	1	Einführung und Wiederholung
	2	Lineare Regression
	3	Interpretation und Vergleich von Regressionsmodellen
	4	Heteroskedastie und Autokorrelation
	5	Maximum Likelihood und bivariate abhängige Variablen
	6	Endogenität und Instrumentvariablen

### Prüfungen und Kreditpunkte

Die Veranstaltung wird durch eine Klausur (90 Minuten) am 22.07.2022 um 15.00 Uhr abgeschlossen. Im Sommersemester gibt es keine Möglichkeit zur Anfertigung einer Hausarbeit.

### Literatur und Materialien

Die Vorlesung stützt sich auf Vorlesungsfolien, die im Internet bereitgestellt werden. Sie folgt dem Lehrbuch: Verbeek, Marno, 2017, A Guide to Modern Econometrics, 5. Auflage, John Wiley Publishers (Kapitel 1-4 und 6). Weitere empfehlenswerte Literaturquellen sind:

- Angrist, J.D. und J.-S. Pischke, 2015, Mastering Metrics, Princeton Univ. Press, Princeton.
- Greene, W.H., 2020, Econometric Analysis, 8.A., Prentice Hall, New Jersey
- Gujarati, D. N. und D. C. Porter, 2009, Basic Econometrics, 5.A., McGraw Hill, New York
- Wooldridge, J. M., 2010, Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, 2.A., MIT Press, Cambridge/Mass., London

Als Einführung eignet sich beispielsweise:

- Wooldridge, J. M., 2016, Introductory Econometrics. A Modern Approach, 6.A., South Western CENGAGE Learning.

Online Stata-Kurse finden sich hier:

- <https://data.princeton.edu/stata/>
- <http://tutorials.iq.harvard.edu/Stata/StataIntro/StataIntro.html>
- <http://personal.lse.ac.uk/lembcke/ecStata/2010/MResStataNotesOct2010PartA.pdf>