

Brückenkurs: Einführung in die Ökonometrie

Ort: Findelgasse Raum FG 0.015 und online via
<https://fau.zoom.us/j/61358259736?pwd=ZjBuZnpKUk5FQmNwVWI0b2FzSmJTZz09>
Meeting-ID: 613 5825 9736 Kenncode: 909526

Zeit: Mo – Do 09.10. - 12.10.2023 jeweils von 9 - 14 Uhr

Sprechstunde: Nach Vereinbarung (Herr Winkler).

1. Motivation

Eine der zentralen Fähigkeiten, die mit dem Studium der Wirtschaftswissenschaften vermittelt werden, ist die, empirische Untersuchungen verstehen und selbst erstellen zu können. Die Veranstaltung führt in die Verfahren ein, die in der empirischen Wirtschaftsforschung angewendet werden. Die Veranstaltung ist durch eine beispielgetriebene Vorgehensweise gekennzeichnet.

2. Inhalt

Die Gliederung der Veranstaltung und die Präsentation folgen eng dem Lehrbuch von Wooldridge (s.u.). Dabei steht das Verständnis des Kleinstquadratenschätzers, seiner Eigenschaften und der Bedeutung der unterliegenden Annahmen im Vordergrund. Der Kurs bietet darüber hinaus eine erste Vorstellung des Statistikpakets Stata sowie eine Einführung in die Matrizenrechnung.

- | | | |
|----|--|----------------------|
| 1. | Einführung und Repetitorium | W: 1, App. A, App. B |
| 2. | Einführung in die lineare Algebra | App. D |
| 3. | Das einfache Regressionsmodell | W: 2 |
| 4. | Multiple Regression: Schätzung | W: 3 |
| 5. | Multiple Regression: Inferenz | W: 4 |
| 6. | Asymptotische Eigenschaften des KQ Schätzers | W: 5 |
| 7. | Anwendungen des KQ Schätzers | W: 6 |
| 8. | Binäre Variablen | W: 7 |

3. Prüfungen und Kreditpunkte

Die Veranstaltung ist freiwillig zu belegen und bietet keine Prüfung an.

4. Literatur und Veranstaltungsunterlagen

Die Veranstaltung wird von einem Kurs im StudOn-Portal begleitet. Dort werden alle Kursunterlagen hinterlegt.

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

Angrist, J. D. und J. S. Pischke, 2014, *Mastering Metrics: The path from cause to effect*. Princeton University Press.

von Auer, Ludwig, 2007, *Ökonometrie. Eine Einführung*, 4. Auflage, Springer Verlag, Berlin, Heidelberg

Hill, R. Carter, William E. Griffiths und George G. Judge, 2001, *Undergraduate Econometrics*, 2. Auflage, John Wiley & Sons, Inc. New York et al.