

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

Die Veranstaltung findet geblockt in der ersten Semesterhälfte statt:

Vorlesung: Mo. und Mi. 8:00-9:30; Raum: LG 0.222/3. Beginn: 20.10.2025

Übung: Parallelveranstaltungen ab 20.10.25, Termine und Anmeldung über StudOn

Tutorien: Angebot ab November, Teilnahme freiwillig, Anmeldung über StudOn

Sprechstunde: Mittwoch 11.00-12.00 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	Endogenität und Instrumentvariablen
	6	Maximum Likelihood und bivariate abhängige Variablen

Prüfungen und Kreditpunkte

Die Veranstaltung wird durch eine Klausur (90 Minuten) am 9.01.2026 (15.00-16.30 Uhr, LG H1) abgeschlossen. Es wird empfohlen, vorlesungsbegleitend eine empirische Hausarbeit anzufertigen. Diese kann in Gruppen mit drei Personen erarbeitet werden. Die Leistung aus der freiwilligen Hausarbeit kann im laufenden WS auf die Endnote angerechnet werden und verfällt anschließend. Die Anmeldung zur Hausarbeit ist bis zum 31.10.2025 über StudOn möglich. Die Themen werden ab 10.11.2025 ausgegeben. Die Hausaufgaben von 3-4 Textseiten sind bis zum 19.12.2024 um 12 Uhr mittags abzugeben.

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., 2019, Econometric Analysis, 8.A., Prentice Hall, New Jersey
- Gujarati, D. N. und D. C. Porter, 2009, Basic Econometrics, 5.A., McGraw Hill, NewYork
- 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., 2024, Introductory Econometrics. A Modern Approach, 8.A., South Western CENGAGE Learning.

Online Stata-Kurse finden sich bspw. hier:

- <https://www.princeton.edu/~otorres/Stata/>
- <http://personal.lse.ac.uk/lembcke/ecStata/2010/MResStataNotesOct2010PartA.pdf>