

VL/UE	Empirische Wirtschaftsforschung 2 (Empirische Wirtschaftsforschung 2, Empirikus gazdasággkutatás 2, Econometrics 2)	
Veranstalter ¹	Martina Eckardt/ Eszter Megyeri	
Zeit	Vorlesung: UKW Mittwoch, 9.30- 11.00 Uhr und 13.45-15.15 Uhr; Übung: Montag, 13.45-15.15 Uhr	
Ort	HS 5 (Vorlesung) und PC-Raum (Übung)	
Anrechnungscode	WIWI063	
Kreditpunkte	6	
Kontaktstunde	Eckardt: UKW - Mittwoch, 16 – 17 Uhr und nach Vereinbarung; Megyeri: Mo 15.30-16.30 und nach Vereinbarung	
Prüfungsanmeldung	über das elektronische Studienverwaltungssystem (ETN)	
Inhalt und Ziele		
<p>Kursbeschreibung: Gegenstand dieser Veranstaltung ist die anwendungsorientierte Vermittlung ökonometrischer Methoden. Aufbauend auf der Grundlagenveranstaltung „Empirische Wirtschaftsforschung I“ werden Kenntnisse der wichtigsten über OLS hinausgehenden ökonometrischen Schätzmethoden vermittelt. Anhand einer Vielzahl von praktischen Übungen werden die Inhalte der Veranstaltung vertieft.</p> <p>Ziele: Dieser Kurs vermittelt die notwendigen Kenntnisse, um ökonometrische wissenschaftliche Arbeiten verstehen und mit spezialisierten Statistikern und Ökonometrikern „auf Augenhöhe“ verhandeln zu können. Die Studierenden werden durch das vermittelte Fach- und Methodenwissen in die Lage versetzt, ökonometrische Studien einer kritischen Prüfung zu unterziehen sowie eigenständig empirische Analysen durchzuführen.</p>		
Kursraster		
Termin	Thema	Literatur
<p>Vorlesung: Mi, 15. Februar, 9.30- 11.00 Uhr und 13.45-15.15 Uhr Mi, 1. März, 9.30- 11.00 Uhr und 13.45-15.15 Uhr Di, 14. März, HS 5 15.45-17.15 Uhr Mo, 20. März, HS 1 9.30- 11.00 Uhr und 13.45-15.15 Uhr Mi, 29. März, 9.30- 11.00 Uhr und 13.45-15.15 Uhr Mi, 26. April, HS 1 9.30- 11.00 Uhr (Klausur 1) und 13.45-15.15 Uhr (Übung)</p>	<p>1. Einführung: externe und interne Validität , Spezifikationsfehler, Testverfahren 2. Schätzmethoden für qualitative abhängige Variablen 2.1 Logistische Regression, Logit und Probit 2.2 Weitere Modelle (ordinal, multinomial, Tobit ...) 3. Experimentelle Verfahren: Zufallsexperimente, Natürliche Experimente 3.1 Zufallsexperimente 3.2 Quasiexperimente 4. Panel Daten-Modelle 5. Dynamische Modelle 5.1 Ad hoc distributed Modelle und dynamische Modelle 3.2 Autokorrelation im dynamischen Modell 5.3 Granger Kausalität 6. Zeitreihenanalyse 6.1 Stationarität und Nicht-Stationarität 6.2 Cointegration und Error Correction Modelle, 6.3 Arch und Garch-Modelle</p>	<p>Gujarati, Damodar N., Porter, Dawn C. (2009): Basic Econometrics, New York, Boston et al. 5. Aufl., Kap.15-22</p> <p>Gujarati, Damodar N. (2012): Econometrics by Example, New York</p> <p>Stock, James A., Watson, Mark W. (2011), Introduction to Econometrics, Boston et al., 3.Aufl., Kap. 10-16</p> <p>Studenmund, A.H. (2011), Using Econometrics. A Practical Guide, Boston et al., 6.Aufl. , Kap.11-16</p>

¹ Die Namen der Veranstalter sind ohne Titel aufzuführen.

Di, 2. Mai, PC-Raum
9.30-11.00 Uhr und
13.45-15.15 Uhr
Mi, 10. Mai,
9.30- 11.00 Uhr (Übung)
Mo, 15. Mai, HS 1
13.45-15.15 Uhr (**Klausur 2**)

Übung:
i.d.R. Wöchentlich, Montag,
13.45-15.45 Uhr

7. Simultangleichungsmodelle
7.1 Simultangleichungsmodelle
7.2 Das Identifikationsproblem
8. Prognosemodelle

Bewertung

Form und Umfang der zu erbringenden Leistungen: Prüfungsform: Für diesen Kursus im ökonomischen Programm erhalten Sie sechs Kreditpunkte. Als Prüfungsleistung sind zwei schriftliche Leistungsnachweise zu erbringen (= 50% der Note) sowie in der Prüfungsperiode eine anwendungsorientierte Klausur (= 50% der Note) zu bestehen.

Folgenden Stoffgebiete werden in den beiden schriftlichen Klausuren abgeprüft:

Klausur 1 (Mi, 26. April, HS 1): Externe und interne Validität, Schätzmethoden für qualitativ abhängige Variablen, Experimentelle Verfahren, Panel-Datenmodelle

Klausur 2 (Mo, 15. Mai, HS 1): Dynamische Modelle, Zeitreihenanalyse, Simultangleichungsmodelle, Prognosemodelle