

VL/UE	Empirische Wirtschaftsforschung 2 (Empirische Wirtschaftsforschung 2, Empirikus gazdaságtudatás 2, Econometrics 2)
Veranstalter ¹	Martina Eckardt/ Eszter Megyeri
Zeit	Vorlesung: GWK Mittwoch, 9.30- 11.00 Uhr und 13.45-15.45 Uhr, sowie Dienstag, 24. Februar, 9.30-11.00 Uhr und 15.45-17.15 Uhr Übung: Montag, 13.45-15.45 Uhr
Ort	HS 1 (Vorlesung) und PC-Raum (Übung)
Anrechnungscode	WIWI063
Kreditpunkte	6
Kontaktstunde	Eckardt: Dienstag, 14 – 15 Uhr und nach Vereinbarung; Megyeri: Mittwoch, 14 – 15 und nach Vereinbarung
Prüfungsanmeldung	über das elektronische Studienverwaltungssystem (ETN)

Inhalt und Ziele

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.

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.

Kursraster

Termin	Thema	Literatur
Vorlesung: Jeweils Mittwoch, 9.30- 11.00 Uhr und 13.45-15.45 Uhr am: 18.Februar 18. März 15. April 29. April 13. Mai Zudem: 24. Februar, 9.30-11.00 Uhr und 15.45 – 17.15 Uhr 17.März, 9.30-11.00 Uhr	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 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 7. Simultangleichungsmodelle 7.1 Simultangleichungsmodelle	Gujarati, Damodar N., Porter, Dawn C. (2009): Basic Econometrics, New York, Boston et al. 5. Aufl., Kap.15-22 Gujarati, Damodar N. (2012): Econometrics by Example, New York Stock, James A., Watson, Mark W. (2011), Introduction to Econometrics, Boston et al., 3.Aufl., Kap. 10-16 Studenmund, A.H. (2011), Using Econometrics. A Practical Guide, Boston et al., 6.Aufl. , Kap.11-16

¹ Die Namen der Veranstalter sind ohne Titel aufzuführen.

Übung: Wöchentlich, Montag, 13.45-15.45 Uhr	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 regelmäßige Leistungsnachweise zu erbringen sowie in der Prüfungsperiode eine anwendungsorientierte Klausur zu bestehen.