

Ökonometrie

Wintersemester 2019/20

Prof. Dr. Jürgen Bitzer

Vorlesungstermine und -räume:

Vorlesung: Mo. 10.15-11.45 Uhr, HS: A05 0-056

Übung: Mi. 10.15-11.45 Uhr HS: A5 1-161 CIP-Raum ODER

Do. 8.15-9.45 Uhr HS: A5 1-161 CIP-Raum

Beginn: 14. Oktober 2019 Ende: 30. Januar 2020

Inhalt

Der Kurs dient als Einführung in die Ökonometrie. Die Veranstaltung wiederholt die notwendigen statistischen Grundlagen, vertieft die Kenntnisse der multiplen Regression und führt die Teilnehmer an die fortgeschrittenen Themen Panel-Daten-Regression, binäre abhängige Variablen, Instrumenten Variablen Schätzung und Zeitreihenanalyse heran. Ziel der Vorlesung ist es, die Teilnehmer in die Lage zu versetzen, das Analyse-Instrument der Ökonometrie in empirischen Studien einsetzen zu können.

Struktur und Ablauf der Veranstaltung

Die Vorlesung folgt in ihrer Struktur weitgehend der Gliederung des Buchs von Stock und Watson (2020). Es werden die ersten zwölf und das fünfzehnte Kapitel des Buches durchgearbeitet. In jeder zweistündigen Vorlesung wird jeweils ein Kapitel besprochen. Da die einzelnen Kapitel ca. 30 Seiten lang sind, müssen somit pro Vorlesungswoche ungefähr 30 Seiten Stoff vor- und nachbereitet werden. Die Vorlesung verwendet einen Problem-Based-Learning-Ansatz, bei dem die einzelnen Themenkomplexe anhand von konkreten Beispielen behandelt werden. Die Übung findet im Computerlabor statt um das in der Vorlesung vermittelte Wissen mit Hilfe der Ökonometriesoftware STATA an konkreten Datensätzen anzuwenden.

Literatur

Stock, James H. und Mark W. Watson (2020): Introduction to Econometrics, 4th edition, Pearson Education Limited: Harlow, UK.

Weitere Literatur zum Thema

Hill, R. Carter und William E. Griffiths (2018): Principles of Econometrics, 5th edition, Wiley & Sons.

Wooldridge, Jeffrey M. (2019): Introductory Econometrics: A Modern Approach, 7th edition, South-Western Cengage Learning.

von Auer, Ludwig (2016): Ökonometrie: Eine Einführung, 7. durchgesehene und aktualisierte Auflage, Springer: Berlin.

Literatur zu STATA

Baum, Christopher F. (2006): An Introduction to Modern Econometrics Using Stata, Stata Press: College Station.

Bittmann, Felix (2019): Stata: A Really Short Introduction, 1. Auflage, De Gruyter Oldenbourg. Als Ebook in der Bibliothek verfügbar.

Kohler, Ulrich und Frauke Kreuter (2016): Datenanalyse mit Stata: Allgemeine Konzepte der Datenanalyse und ihre praktische Anwendung, 5. aktualisierte und überarbeitete Auflage, Oldenbourg Verlag.

Literatur zum mathematischen Hintergrund

Abadir, Karim M. und Jan R. Magnus (2005): Matrix Algebra, Econometric Exercises Volume 1, Cambridge University Press.

Chiang, Alpha C. and Kevin Wainwright (2005): Fundamental Methods of Mathematical Economics, 4th edition, McGraw-Hill: New York.

Schmidt, Karsten und Götz Trenkler (2015): Einführung in die Moderne Matrix-Algebra: Mit Anwendungen in der Statistik, 3. überarb. Aufl., Springer Gabler.

Sydsaeter, Knut and Peter Hammond (2018): Mathematik für Wirtschaftswissenschaftler, 5. aktualisierte Auflage, Pearson Studium. Oder die englische Fassung: Sydsaeter, Knut and Peter Hammond (2016): Essential Mathematics for Economic Analysis, 5th revised edition, Prentice Hall: Harlow.

Sydsaeter, Knut, Peter Hammond, Atle Seierstad und Arne Strøm (2008): Further Mathematics for Economic Analysis, 2nd edition, Prentice Hall: Harlow.

Tietze, Jürgen (2013): Einführung in die angewandte Wirtschaftsmathematik, 17. Auflage, Springer Spektrum.