

WIRTSCHAFTSWISSENSCHAFTLICHE FAKULTÄT



UNIVERSITÄT  
LEIPZIG

Institut für Empirische Wirtschaftsforschung (IEW)

Volkswirtschaftslehre, insbesondere Ökonometrie

Prof. Dr. Bernd Süßmuth

# Ökonometrie

## Kurzbeschreibung

Die Veranstaltung vermittelt grundständige Methoden, Vorgehensweisen und Verfahren der modernen Ökonometrie und damit die Grundlagen der empirischen Wirtschaftsforschung. Durch Mitarbeit und selbstständiges Arbeiten in den Übungen wird der Umgang mit EViews, einem anwenderfreundlichen, standardisierten Computerprogramm, erlernt.

Zunächst werden Basiskonzepte der induktiven Statistik als Grundlage des einfachen Ordinary-Least-Squares- (OLS-) Modells wiederholt. Die Annahmen des einfachen Modells werden besprochen und Auswege bei Verletzung der Annahmen aufgezeigt. Nach Motivation und Herleitung des multiplen OLS-Regressionsmodells werden die Problemfelder Multikollinearität und stochastische Regressoren behandelt und Lösungswege aufgezeigt. Als Alternative zum OLS-Verfahren und zur Schätzung nicht-linearisierbarer Modelle wird die Maximum-Likelihood-Methode motiviert und besprochen. Sie wird im Anschluss angewandt im Rahmen von Qualitativvariablen-Modellen. Im letzten Teil der Veranstaltung wird eine Einführung in Methoden der Zeitreihenanalyse gegeben. Im Vordergrund stehen dabei die Identifikation datengenerierender stochastischer Prozesse und anwendungsrelevante Verfahren zur Untersuchung von Trend, zyklischer und irregulärer Komponente von Zeitreihen. Im praktischen Teil der Veranstaltung werden die theoretisch dargestellten Methoden und Verfahren anhand empirischer Problemstellungen aus diversen Gebieten der Wirtschaftswissenschaften angewandt.

## Prüfungsleistungen und Kreditpunkte

Modulprüfung: Klausur à 90 Min.; Gesamtes Modul 07-101-4101 = 10 Leistungspunkte

## Unterlagen und Material

Die Vorlesung stützt sich auf Vorlesungsfolien, die vorab ins Internet gestellt werden – Zugang über die Netzseiten des Lehrstuhls; Passwort wird in der ersten Vorlesung bekanntgegeben – und folgt eng dem Lehrbuch Komlos, John und Bernd Süßmuth (2010), *Empirische Ökonomie. Eine Einführung in Methoden und Anwendungen*, Springer.

## Gliederung

- 1 Einführung
- 2 Vorüberlegungen und Grundbegriffe
- 3 Momentenschätzung auf der Basis von Stichproben
- 4 Basiskonzepte der induktiven Statistik
- 5 Einfaches OLS-Regressionsmodell
- 6 Multiples OLS-Regressionsmodell
- 7 Maximum-Likelihood-Schätzung
- 8 Qualitativvariablen-Modelle
- 9 Zeitreihenanalyse

## Literatur

Komlos, J. und B. Süßmuth (2010): *Empirische Ökonomie. Eine Einführung in Methoden und Anwendungen*, Springer, Heidelberg.