

Vorlesungsplan

1. Einführung

Daten, ökonomische Modelle, Schätzen und Testen, Kausalität, Prognose und wirtschaftspolitische Evaluation. (Kap. 1: S. 1 – 19 in *Wooldridge*, 2 ed., s. Literaturangabe).

Das Lineare Regressionsmodell – Arbeitspferd der empirischen Wirtschaftsforschung: Eigenschaften und Beschränkungen – Wiederholung der zentralen Annahmen und Eigenschaften des KQ-Schätzers (wird als bekannt vorausgesetzt (Ökonometrie I bzw. Einführung in die Ökonometrie; zur Auffrischung: Kap. 2 – 5 in Wooldridge oder Kap. 2 – 4 in VL-Folien; komprimiert und etwas formaler: Kap. 2 in Verbeek)

2. Querschnittsdatenanalyse, Heteroskedastie und die Verallgemeinerte KQ-Schätzung

Praktische Aspekte der Regressionsanalyse: Skalierung der Daten, Nichtlinearitäten, Dummy-Variablen, Prognose und Residuenanalyse

(Kap. 6: 182 – 210, Kap. 7: 218 – 248)

Heteroskedastie und Effizienz der KQ-Schätzung, Tests auf Heteroskedastie und heteroskedastie-robuste Standardfehler, Gewichtete und verallgemeinerte KQ-Schätzung

(Kap. 8: 257 – 283)

Anwendungsbeispiele: Hedonische Preisfunktionen und Qualitätsmessung (Preisfunktion für Wohnen; Messung Lohndiskriminierung)

3. Endogenitätsproblem, Instrumentvariablen- und zweistufige KQ-Schätzung

Gründe für Endogenität: Messfehler in erklärenden Variablen, Vernachlässigung erklärender und endogene erklärende Variable; Identifikation, Eigenschaften von Instrumentvariablen, IV-Schätzung, zweistufige KQ-Schätzung (2SLS), Tests auf Endogenität

(Kap. 15: 484 – 509)

Anwendungsbeispiele: Endogenitätsverzerrung bei geschätzten Bildungsrenditen

4. Mehrgleichungssysteme mit Querschnittsdaten

Schätzung verbundener linearer Gleichungssysteme: gepoolte KQ-Schätzung, GLS, SUR Schätzung (Seemingly Unrelated Regressions)

(VL-Folien, Greene, Kap. 14)

Simultane Gleichungssysteme: Identifikation und Schätzung (IV, 2SLS)

(Wooldridge, Kap. 16: 525 – 540)

Anwendungsbeispiele: Nachfrage der Unternehmen nach Produktionsfaktoren; Preiselastizitäten im Marktmodell

5. Binäre und zensierte abhängige Variable, Selektionsmodelle

Modelle mit binär abhängigen Variablen: Logit- und Probit-Modelle, Maximum-Likelihood Schätzung, Interpretation der geschätzten Koeffizienten, Hypothesentests

(Kap. 17: 553 – 564)

Zensierung und Selektivität, Tobit-Modell, Interpretation der Koeffizienten und Elastizitäten, Regressionsmodelle mit Selektionskorrektur, Selektionsverzerrung und Treatment-Effekte

(Kap. 17: 565 – 572, 585 – 591).

Anwendungsbeispiele: Arbeitsangebotschätzungen; Lohnfunktionen mit Selektionskorrektur

6. Regressionsmodelle für Paneldaten

Arten von Paneldaten, Natürliche Experimente und Politikanalyse, Differenzen-von-Differenzen Schätzung, (Kap. 13: 425 – 453)

Regression mit fixen und zufälligen Effekten im statischen linearen Panelmodell (Kap. 14: 461 – 473).

Dynamische Panelmodelle: Autokorrelation, Endogenität, 2SLS-Schätzung

(Kap. 12: 395 – 410, VL-Folien; Kap. 15, 511-514).

Anwendungsbeispiele: Schätzung von Produktions- und Investitionsfunktionen