

Ökonometrisches Seminar Sommersemester 2014

Die Seminararbeit kann in Form einer eigenständigen Aufbereitung der aktuellen Literatur auf dem jeweiligen Gebiet, einer empirischen Untersuchung oder einer Simulationsstudie erfolgen. Die gelieferte Literatur soll als Ausgangspunkt verstanden werden und die angefügten Links sollen zur selbständigen weiterführenden Literaturrecherche anregen. Nach Absprache sind auch eigene Themenvorschläge möglich.

Für Bachelorstudenten ist es im allgemeinen ausreichend, Lehrbuchstoff zu bestimmten ökonometrischen Verfahren aufzuarbeiten und eventuell empirisch zu illustrieren. Einige für Bachelorstudenten gut zugängliche Lehrbücher (die möglicherweise in aktuelleren Auflagen vorliegen) sind im folgenden aufgeführt. Titel mit * sind tendenziell anspruchsvoller.

- Wooldridge JM. 2006. *Introductory Econometrics*. New York: Itps Thomson Learning, 3rd edn
- von Auer L. 2003. *Ökonometrie - Eine Einführung*. Berlin: Springer
- Verbeek M. 2000. *A Guide To Modern Econometrics*. New York: John Wiley & Sons*
- Stock JH, Watson MW. 2006. *Introduction to Econometrics*. New York: Addison Wesley
- Baum CF. 2006. *An Introduction to Modern Econometrics Using Stata*. College Station: Stata Press books
- Studenmund A. 2006. *Using Econometrics: A Practical Guide*. Reading: Addison Wesley, 5th edn
- Gujarati DN. 1995. *Basic Econometrics*. New York: McGraw-Hill, third edn
- Pindyck RS, Rubinfeld DL. 1998. *Econometric Models and Economic Forecasts*. New York: McGraw-Hill, 4th edn
- Greene WH. 2003. *Econometric Analysis*. Upper Saddle River: Prentice-Hall, 5th edn*
- Johnston J, DiNardo J. 1997. *Econometric Methods*. New York: McGraw-Hill
- Baltagi BH. 2002. *Econometrics*. Berlin: Springer, 2nd edn*
- Enders W. 1995. *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley & Sons

Im folgenden werden mögliche Seminarthemen genannt, die auf Basis dieser Lehrbücher bearbeitet werden können. Da die Themen nicht notwendigerweise in einer engen Beziehung zueinander stehen, ist es besonders im Rahmen der Präsentation wichtig, den Mitstudenten den grundlegenden Ansatz und Zweck der Verfahren klar nahe zu bringen. Dies ist beispielsweise oft gut mit einer empirischen Anwendung zu erreichen.

- Testen auf Einheitswurzeln
- Testen und Schätzen von Kointegrationsbeziehungen
- Distributed-lag-modelle

- Lineare Paneldatenmodelle
- difference-in-difference Schätzung
- Das Tobitmodell
- VAR-Modelle
- (G)ARCH-Modelle
- The linear probability model
- Simultaneous equation models
- Multinomiale Modelle
- Treatment-Effekte
- Faktormodelle