

<b>Modulbezeichnung</b>		<b>Kurzbezeichnung</b>
Ökonometrie 2		12-M-OE2-102-m01
<b>Modulverantwortung</b>		<b> anbietende Einrichtung</b>
Inhaber/-in des Lehrstuhls für Ökonometrie		Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät
<b>ECTS</b>	<b>Bewertungsart</b>	<b>zuvor bestandene Module</b>
5	numerische Notenvergabe	--
<b>Moduldauer</b>	<b>Niveau</b>	<b>weitere Voraussetzungen</b>
1 Semester	weiterführend	--
<b>Inhalte</b>		
<p>Beschreibung: Das Modul vermittelt Grundlagen, Methoden und Konzepte zur Schätzung des verallgemeinerten linearen Regressionsmodells (GLS). Motiviert wird dies auf Grundlage von Spezifikationsproblemen, Datenproblemen und Verletzungen von Modellannahmen des in "Ökonometrie I" eingeführten klassischen linearen Modells (OLS). Insbesondere werden hier Multikollinearität, Test auf Strukturbruch, Heteroskedastie und Autokorrelation der Störterme behandelt. Die lineare Algebra wird dabei als hilfreicher Formalapparat verwendet.</p> <p>Gliederung:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Spezifikationsanalyse</li> <li>2. Multikollinearität</li> <li>3. Heteroskedastie</li> <li>4. Autokorrelierte Störterme</li> <li>5. Verallgemeinertes lineares Regressionsmodell (GLS)</li> </ol>		
<b>Qualifikationsziele / Kompetenzen</b>		
<p>Die Studierenden erlangen wesentliche Kenntnisse der Grundlagen, Methoden und Konzepte zur Schätzung des verallgemeinerten linearen Regressionsmodells (GLS) und können dieses anwenden und interpretieren. Sie werden für Spezifikationsprobleme, Datenprobleme und Verletzungen der Annahmen des klassischen linearen Modells (OLS) sensibilisiert, so dass sie in der Lage sind diese Probleme in Theorie und Praxis zu erkennen, zu beurteilen und damit angemessen umzugehen. Dies befähigt sie zur kritischen Beurteilung des Einsatzes von Schätzmethoden in wissenschaftlichen Arbeiten sowie zur eigenständigen adäquaten Durchführung empirischer Analysen zur Beantwortung ausgewählter (wirtschafts)wissenschaftlicher Fragestellungen wenn die vorliegenden Daten mit o.g. Problemen behaftet sind. Die erlangten Kompetenzen dienen als Basis für die Aufbaukurse "Ökonometrie III", "Mikroökonomie" und "Finanzmarktökonomie".</p>		
<b>Lehrveranstaltungen</b> (Art, SWS, Sprache sofern nicht Deutsch)		
V + Ü (keine Angaben zu SWS und Sprache verfügbar)		
<b>Erfolgsüberprüfung</b> (Art, Umfang, Sprache sofern nicht Deutsch / Turnus sofern nicht semesterweise / Bonusfähigkeit sofern möglich)		
Klausur (ca. 60 Min.)		
<b>Platzvergabe</b>		
--		
<b>weitere Angaben</b>		
--		
<b>Arbeitsaufwand</b>		
--		
<b>Lehrturnus</b>		
--		
<b>Bezug zur LPO I</b>		
--		



**Verwendung des Moduls in Studienfächern**

Master (1 Hauptfach) Business Management (2010)

Master (1 Hauptfach) Economics (2010)