

Modulbezeichnung		Kurzbezeichnung
Econometrics 2		12-M-OE2-242-m01
Modulverantwortung		anbietende Einrichtung
Inhaber/in des Lehrstuhls für Ökonometrie		Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät
ECTS	Bewertungsart	zuvor bestandene Module
5	numerische Notenvergabe	--
Moduldauer	Niveau	weitere Voraussetzungen
1 Semester	weiterführend	--
Inhalte		
<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 bei dem in "Ökonometrie I" eingeführten klassischen linearen Modell (OLS). Insbesondere werden hier Multikollinearität, Test auf Strukturbruch, Heteroskedastizität und Autokorrelation der Störterme behandelt. Die lineare Algebra wird dabei als hilfreicher Formalapparat verwendet.</p> <p>Gliederung:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Spezifikationsanalyse 2. Multikollinearität 3. Heteroskedastizität 4. Autokorrelierte Störterme 5. Verallgemeinertes lineares Regressionsmodell (GLS) 		
Qualifikationsziele / Kompetenzen		
<p>Die Studierenden erlangen wesentliche Kenntnisse der Grundlagen, Methoden und Konzepte zur Schätzung des verallgemeinerten linearen Regressionsmodells (GLS) und können diese anwenden und interpretieren. Sie werden für Spezifikationsprobleme, Datenprobleme und Verletzungen der Annahmen des klassischen linearen Modells (OLS) sensibilisiert, sodass 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 und 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>		
Lehrveranstaltungen (Art, SWS, Sprache sofern nicht Deutsch)		
V (2) + Ü (2) Veranstaltungssprache: Englisch		
Erfolgsüberprüfung (Art, Umfang, Sprache sofern nicht Deutsch / Turnus sofern nicht semesterweise / Bonusfähigkeit sofern möglich)		
a) Klausur (ca. 60 Min.) oder b) Hausarbeit (ca. 15 S.) Prüfungssprache: Englisch bonusfähig		
Platzvergabe		
--		
weitere Angaben		
--		
Arbeitsaufwand		
150 h		



Lehrturnus

k. A.

Bezug zur LPO I

--

Verwendung des Moduls in Studienfächern

Master (1 Hauptfach) Management (2024)

Master (1 Hauptfach) International Economic Policy (2024)

Master (1 Hauptfach) Wirtschaftsmathematik (2024)