

<b>Modulbezeichnung</b>		<b>Kurzbezeichnung</b>
Ökonometrie 3		12-M-OE3-102-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><b>Beschreibung:</b> Das Modul vermittelt weiterführende Methoden und Konzepte der Ökonometrie, die über das in "Ökonometrie I" behandelte klassische und das in "Ökonometrie II" behandelte verallgemeinerte lineare Regressionsmodell hinausgehen. Insbesondere werden hier der Instrumentalvariablen-Schätzer (IV), die generalisierte Momentenmethode (GMM), dynamische Distributed Lag Modelle sowie grundlegende Methoden und Konzepte der uni- und multivariaten ökonometrischen Zeitreihenanalyse (Stationarität, Nichtstationarität, Integration, Kointegration) behandelt. Die lineare Algebra wird dabei als hilfreicher Formalapparat verwendet.</p> <p><b>Gliederung:</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Fehler in den Variablen</li> <li>2. IV-Schätzer</li> <li>3. Generalisierte Momentenmethode (GMM)</li> <li>4. Distributed Lag Modelle</li> <li>5. Stationäre univariate und multivariate Prozesse</li> <li>6. Deterministische und stochastische Trends</li> <li>7. Integrierte und kointegrierte Prozesse</li> </ol>		
<b>Qualifikationsziele / Kompetenzen</b>		
<p>Die Studierenden erwerben ein gründliches Verständnis der fortgeschrittenen Methoden und Konzepte in Ökonometrie. Sie sind mit diversen Fehler-in-Variablen Themen vertraut und in der Lage, angemessen mit diesen umzugehen. Nach dem Kurs verstehen die Studierenden die verallgemeinerte Momentenmethode (GMM) und die Instrumentalvariable (IV) sowie Schätzer in einem Ausmaß, dass sie ihre Vor- und Nachteile diskutieren können, diese bei ausgewählten Fragen im Bereich Quantitative Economics anwenden und wissenschaftliche Arbeiten verstehen, welche diese Methoden verwenden. Sie werden außerdem auf spezielle Probleme der Zeitreihenregression aufmerksam gemacht und in die Lage versetzt diesen mittels dynamischer Distributed Lag Modelle angemessen zu begegnen. Darüber hinaus werden sie auf das Problem der Nichtstationarität sowie deren Folgen für die Schätzung und Interpretation der Ergebnisse sensibilisiert wodurch sie fähig sind eine adäquate Analyse von Zeitreihen durchzuführen, Scheinkorrelationen von kointegrierten Prozessen zu unterscheiden und ihre Ergebnisse sinnvoll zu interpretieren. Zusammenfassend werden die Studierenden also befähigt die Angemessenheit des Einsatzes der o.g. Verfahren in praxisbezogenem Kontext kritisch zu beurteilen sowie in die Lage versetzt eigenständige angemessene empirische Analysen zur Beantwortung ausgewählter (wirtschafts)wissenschaftlicher Fragestellungen, die den Einsatz o.g. Methoden erfordern, durchzuführen.</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>		
--		

**Bezug zur LPO I**

--

**Verwendung des Moduls in Studienfächern**

Master (1 Hauptfach) Business Management (2010)

Master (1 Hauptfach) Economics (2010)