RUPRECHT-KARLS-UNIVERSITÄT HEIDELBERG
ALFRED-WEBER-INSTITUT FÜR
WIRTSCHAFTSWISSENSCHAFTEN
Lehrstuhl für Empirische Wirtschaftsforschung
Prof. Dr. Christian Conrad

Wintersemester 2013/14

Econometrics

Vorlesung	Di.	09:00	12:00	Gr. HS, Bergheimer Str. 58
Übung bzw. STATA Übung	Mo.	12.00	14.00	BergheimerS 58, 4310 / ÜR 02.036 bzw. PC-Pool I
Übung bzw. STATA Übung	Mo.	14.00	16.00	BergheimerS 58, 4310 / ÜR 02.036 bzw. PC-Pool I
Übung bzw. STATA Übung	Do.	09.00	11.00	BergheimerS 58, 4310 / ÜR 01.030 bzw. PC-Pool I

Beginn der Vorlesung: Dienstag, 15.10.2013
Beginn der Übungen: Montag, 21.10., bzw. Donnerstag, 24.10.2013

Kurzkommentar:

Die Vorlesung „Ökonometrie“ ist eine Pflichtveranstaltung des MSc in Economics. Studierende des Diplom VWL Studiengangs können die Veranstaltung für die Vertiefungsfächer „Theoretische Statistik“ und „Ökonometrie“ belegen.

Vor Beginn des Semesters wird ein „Vorkurs Ökonometrie“ angeboten, in dem die wichtigsten Konzepte der Wahrscheinlichkeitsrechnung, der induktiven Statistik sowie der Matrixalgebra wiederholt werden. Termine und Zeiten des Vorkurses werden auf der Webseite des Lehrstuhls für Empirische Wirtschaftsforschung bekannt gegeben.

Die Veranstaltung gibt eine Einführung in die wichtigsten ökonometrischen Methoden zur Analyse von Querschnitts-, Panel- und Zeitreihendaten. Die Vorlesung wird durch methodische und empirische Übungen begleitet.

Inhalt:

1. The Linear Regression Model
2. Models for Panel Data
3. Instrumental Variables Regression
4. Experiments and Quasi-Experiments
5. Microeconometrics
6. Time Series

Kurssprache: Englisch

Leistungsnachweis:

Die Note für diese Vorlesung wird durch eine Klausur am Semesterende festgelegt. Es besteht aber die Möglichkeit, Zusatzpunkte durch die Abgabe von Aufgabenblättern zu erwerben.

Literatur:

- W. H. Greene, Econometric Analysis, 7. Auflage, Prentice Hall, 2012
- F. Hayashi, Econometrics, Princeton University Press, 2000
- J. H. Stock und M. W. Watson, Introduction to Econometrics, 3. Auflage, Addison-Wesley, 2012
- J. M. Wooldridge, Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, 2. Auflage, MIT Press, 2002
- J. M. Wooldridge, Introductory Econometrics, 3. Auflage, South-Western College Publishing, 2006.