

Gliederung zur Vorlesung
Grundlagen der Ökonometrie
Sommersemester 2008

1	Einführung	Teil I
1.1	Gegenstand	1
1.2	Arbeitsphasen	1
1.3	Modellbegriffe	3
1.4	Lineare Einfachregression	5
1.4.1	Regressionsbeziehungen in einer Grundgesamtheit	5
1.4.2	Stichproben - Regressionsfunktionen	6
1.4.3	Modellannahmen	7
1.4.4	Eigenschaften von Schätzungen	8
1.4.5	Kleinst - Quadrat - Methode	9
1.4.6	Maximum - Likelihood - Methode	10
1.4.7	Beispiel (Excess-Return-Modell)	11
2	Klassisches Regressionsmodell	
2.1	Spezifikation	12
2.1.1	Multiple lineare Regression	12
2.1.2	Multiple lineare Regression in Matrixschreibweise	13
2.2	Parameterschätzungen	14
2.2.1	Schätzung von β	14
2.2.2	Varianz - Kovarianzmatrix von b	15
2.3	Beurteilung	16
2.3.1	Varianzanalyse-Schema	16
2.3.2	Determinationskoeffizienten	17
2.3.3	Parameter-tests	18
2.3.4	Konfidenzintervalle	22
2.4	Prognosen	23
2.5	Beispiele	25
2.5.1	Konsumfunktion (Matrizendarstellung)	25
2.5.2	Hypothetische Nachfragefunktion	28
2.5.3	Konsumfunktion BR Deutschland	30
2.5.4	Nachfragefunktion für Telefonanschlüsse	32

3	Probleme im klassischen Regressionsmodell	Teil II
3.1	Spezifikationsfragen	34
3.1.1	Granger-Kausalität	34
3.1.2	Meßfehler und Instrumentvariablen-Methode	36
3.1.3	Spezifikationsfehler i. e. S.	38
3.1.4	Spezifikationstests	39
3.2	Heteroskedastie	43
3.3	Autokorrelation	49
3.4	Verteilung der latenten Variablen	56
3.5	Multikollinearität	57
4	Sonderfragen	
4.1	Qualitative Regressoren	61
4.2	Qualitative Regressanden	64
4.3	Verzögerte Variablen	67
5	Mehrgleichungsmodelle	
5.1	Modellspezifikation	71
5.1.1	Strukturelle und reduzierte Form	71
5.1.2	Modelltypen	76
5.1.3	Identifikation	78
5.2	Schätzmethoden	81
5.3	Beurteilung	90
5.4	Prognosen	90
5.5	Modellbeispiele und Anwendungsprobleme	91
5.6	Arten der Modellanalyse und Perspektiven	

Literaturhinweise

Eckey, H. F.; Kosfeld, R.; Dreger, Chr. Ökonometrie. Grundlagen - Methoden - Beispiele
3. überarb. u. erw. Aufl., Wiesbaden (Gabler) 2004

Hill, R. C.; Griffiths, W E.; Lim, G. C. Principles of Econometrics
3rd ed., Hoboken (N. J.) (Wiley) 2008

Stock, J. H.; Watson, M. W. Intruduction to Econometrics
2nd ed., Boston usw. (Pearson) 2007

Als Ergänzung:

Auer, L. v. Ökonometrie. Eine Einführung
4. verb. Aufl., Berlin usw. (Springer) 2007

Greene, W. H. Econometric Analysis
6th ed., Upper Saddle River (Prentice Hall) 2007

Heij, Chr.; de Boer, P.; Franses, P. H.; Kloek, T.; van Dijk, H. K. Econometric Methods with Applications in Business
and Economics
Oxford (University Press) 2004

Schulze, P. M.; Prinz, A.; Schweinberger, A. Angewandte Statistik und Ökonometrie mit WinRATS
München/Wien (Oldenbourg) 2006