

Fakultät Statistik - Kommentiertes Vorlesungsverzeichnis

Semester	Wintersemester 2012/2013
Titel der Veranstaltung	Ökonometrie
Art der Veranstaltung	Vorlesung mit Übung (4V + 2Ü)
Module	BS XIII, BD XV
Dozenten	Prof. Dr. Martin Wagner (V) Dr. Sebastian Voß (Ü)
zu erreichen	E-Mail: mawagner@ihs.ac.at
Sprechstunde	Wird bekanntgegeben
Zeit und Ort der Veranstaltung	Vorlesung: Mo 14:00-16:00 Uhr, M/E21 Di 14:00-16:00 Uhr, M/E21 Übungen: nach Vereinbarung
Beginn	Mo, 8.10.2012
Inhalt (vorläufig, es werden vielleicht nicht alle Themen behandelt)	<ul style="list-style-type: none"> • Einleitung • Lineares Regressionsmodell unter Standardannahmen • Lineares Regressionsmodell unter allgemeineren Annahmen • Maximum Likelihood Schätzung und Inferenz in linearen Regressionsmodellen • Asymptotische Theorie für lineare Regressionsmodelle • Spezifikationsanalyse • Endogene Regressoren, IV und GMM • Regressionsmodelle mit Zeitreihendaten • Grundbegriffe der Theorie von Unit Roots und Kointegration
Erforderliche Kenntnisse	Vektor- und Matrizenrechnung, Statistik 1-3, Lineare Modelle
Erwünschte Mitarbeit der Studierenden	<ul style="list-style-type: none"> • Nachbearbeiten der Vorlesung und aktive Teilnahme an der Vorlesung • Bearbeitung der Übungsaufgaben, aktive Teilnahme an den Übungen
Leistungsnachweis (Art des Erwerbs)	Details zu Beginn der Veranstaltung
Lernziele	Erwerb von Kenntnissen zur sachgerechten Anwendung von ökonometrischen Verfahren und Befähigung die

	Methodik an die vorliegende Datensituation anzupassen	
Literatur (Details werden im Rahmen der Vorlesung erläutert)	<ul style="list-style-type: none"> • Hayashi, F. (2000). Econometrics, Princeton University Press • Schönfeld, P. (1969, 1971). Methoden der Ökonometrie, Band I und II, Vahlen • Verbeek, M. (2012). A Guide to Modern Econometrics (4th Edition), Wiley and Sons 	
Studiengänge	Statistik – Diplom	X
	Statistik – Bachelor	X
	Statistik – Master	X
	Datenanalyse und Datenmanagement – Bachelor	
	Datenwissenschaft – Master	
Studienschwerpunkte	Biometrie	
	Technometrie	
	Ökonometrie/Empirische Wirtschaftsforschung	X