

Prof. Dr. Gerhard Untiedt

GEFRA – Gesellschaft für Finanz- und Regionalanalysen und TU Clausthal

Althausweg 117D, 48159 Münster

Empirische Wirtschaftsforschung mit GRETl

SS 2023 Technische Universität Clausthal

Allgemeine Informationen

Lernziele / Kompetenzen

Gegenstand der Vorlesungen / Übungen

Vorlesungsunterlagen

Kontakt

Allgemeine Informationen

- Die Vorlesung/Übung findet als Blockveranstaltung statt am:

Block 1:

4. und 5. Mai 2023, jeweils von 9:30 – 17:00 Uhr

Block 2

15. und 16. Mai 2023, jeweils 9:30 – 17:00 Uhr

- Hörsaal: tba
- Prüfungsleistung: Empirische / Theoretische Arbeit (thA)
- Voraussetzungen sind grundlegende Kenntnisse der deskriptiven und induktiven Statistik und der Mikro- und Makroökonomik..
- Laptop mit Windows 10, macOS oder Linux
- Die Teilnehmerzahl ist auf maximal 15 Studenten und Studentinnen beschränkt.

Lernziele / Kompetenzen

Unter empirischer Wirtschaftsforschung wird die Verbindung von ökonomischer Theorie mit Wirtschaftsdaten unter Verwendung mathematisch statistischer Methoden verstanden, um Aussagen über Wirkungszusammenhänge zu bestimmen und Vorhersagen von wirtschaftlichen Ereignissen zu treffen.

In der Veranstaltung werden die für eine anwendungsorientierte volkswirtschaftliche Analyse notwendigen methodischen Grundlagen und eine Einführung in die ökonometrische Software GRETL vermittelt. Die Studierenden sollten nach Abschluss der Veranstaltung in der Lage, eigenständig einfache ökonomische Fragestellungen in empirische Untersuchungen zu überführen und die zur Durchführung angemessenen statistischen und ökonometrischen Methoden einzusetzen. Insbesondere sind sie

- mit gängigen ökonometrischen Verfahren und ihren Implikationen, ihren analytischen Möglichkeiten und ihren Restriktionen vertraut und
- in der Lage, diese Verfahren in praktischen Analysen zu nutzen und die entsprechende Software dabei einzusetzen.

Gegenstand der Vorlesungen/Übungen:

Die Veranstaltung führt in die empirische Wirtschaftsforschung ein. Ziel ist es, die in der ökonomischen Theorie formulierten Zusammenhänge zu quantifizieren und auf dieser Grundlage Prognosen für zukünftige Entwicklungen zu erstellen.

- Aufgaben der empirischen Wirtschaftsforschung
- Datenquellen, Datenqualität und Erhebungsmethoden
- Spezifikation empirischer Modelle
- Methode der Kleinsten-Quadrate
- Modellannahmen und Implikationen
- Eigenschaften der Methode der Kleinsten-Quadrate
- Statistische Bewertung von Regressionsschätzungen (Gütemaße und Testverfahren)
- Annahmeverletzungen des KQ-Modells (Fehlspezifikation, Multikollinearität, Autokorrelation, Heteroskedastizität)
- Prognose und Prognosequalität
- Einführung in GRETL und empirische Anwendungen

Vorlesungsunterlagen

- Zu dieser Vorlesung gibt es kein Skript.
Powerpoint-Folien werden als PDF-Datei zur Verfügung gestellt.
- Literatur:
 - GRETL - Gnu Regression, Econometrics and Time-series Library, <http://gretl.sourceforge.net/>
 - Malitte, J., S. Schreiber (2019), Ökonometrie verstehen mit Gretl. Eine Einführung mit Anwendungsbeispielen. Springer Verlag, Berlin.
 - Studenmund, E. H.: A Practical Guide to Using Econometrics, Pearson Publishing: Harlow (7. Auflage; Global Edition) 2017.

Kontakt

- Bei Fragen oder Anregungen melden Sie sich bitte per Mail unter untiedt@gefra-muenster.de
- Für ein persönliches Gespräch besteht Gelegenheit nach den Veranstaltungen.