

Empirische Wirtschaftsforschung

Kursüberblick

Ulrich Fritsche

Universität Hamburg

Email: Ulrich.Fritsche@wiso.uni-hamburg.de

Kursgegenstand: Warum Empirische Wirtschaftsforschung?

Die Empirische Wirtschaftsforschung als **praktische Anwendung** statistischer und ökonometrischer Methoden auf reale sozialökonomische Fragestellungen:

- ▶ Nutzung vergangener Daten zur Falsifikation theoretischer Hypothesen
- ▶ Beschreibung der Gegenwart als Grundlage von Politikempfehlung
- ▶ Prognose der zukünftigen Entwicklung

Empirische Wirtschaftsforschung: Möglichkeiten und Probleme

Möglichkeiten:

- ▶ Empirie zur Überprüfung und Gewinnung theoretischer Hypothesen
- ▶ Vermeidung von realitätsferner Spekulation

Probleme:

- ▶ Datenprobleme, Frage der Schätzqualität
- ▶ Theoriefreier Empirismus

Kursinhalte

- ▶ OLS in Matrixschreibweise
Überprüfung ökonomischer Modelle und Hypothesen
- ▶ Maximum-Likelihood
Makro-Modelle, allgemeinerer Schätzansatz
- ▶ Tests auf Annahmeverletzungen
Passt der Schätzansatz zu den Daten?
- ▶ Schätzungen mit Dummyvariablen
Auswirkungen sozioökonomischer Kategorien, Brüche in
Zeitreihen
- ▶ Logit- und Probitmodelle
sozialpolitische Entscheidungen, Stadtplanung, ...
- ▶ Panelschätzungen
Sozioökonomisches Panel
- ▶ Endogenitätsproblem und Instrumentenvariablen
Nichtbeobachtbare Variablen, wechselseitige Effekte

Literatur

- ▶ Verbeek (2008): *A Guide to Modern Econometrics*
- ▶ von Auer (2007): *Ökonometrie: Eine Einführung*
- ▶ Dougherty (2002): *Introduction to Econometrics*
→ zur Wiederholung
- ▶ Matrixalgebra:
 - ▶ MIT Open Course Ware
<http://ocw.mit.edu/OcwWeb/Mathematics/18-06Spring-2005/VideoLectures/>
 - ▶ Übersichtsartikel in Stine

Organisatorisches

- ▶ Übungsteil: Praktische Umsetzung der theoretischen Modelle in Excel/ Gretl: <http://gretl.sourceforge.net/>
- ▶ Sprechstunde: Montag, 13:30-15:00 Uhr
Email: Ulrich.Fritsche@wiso.uni-hamburg.de
Büro: 4.21, Welckerstr. 8
- ▶ Kursabschluss: Zwei einstündige Klausuren