

Bachelor of Science in Betriebswirtschaftslehre

Business Administration

Version PO 09

**Studienplan für die Anrechnung
im Wirtschaftsprüferexamen nach § 13b WPO**

Modulhandbuch

Auszug!

Stand: Wintersemester 2008/2009

x.x.x.x Ökonometrie

Titel der Lehrveranstaltung:	Ökonometrie	
Studiengang:	Business Administration	
Dozent:	Prof. Dr. Peter von der Lippe	
Lernziel der Veranstaltung:	<p>Die Veranstaltung ist eine Vertiefung der Statistik, sie nimmt aber auch Bezug auf volkswirtschaftliche Konzepte (z.B. Zinsstrukturkurve, Konsum- und Produktionsfunktionen, einfache Mehrgleichungsmodelle) sowie auf Statistiksoftware (E-Views). Es werden drei Ziele verfolgt</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. dass die Studierende lernen, mit entsprechenden Daten Regressionsrechnungen und dazu gehörende Tests auf Geltung der Annahmen (z.B. keine Strukturbrüche oder autokorrelierte Residuen etc.) selbst durchzuführen und so ihre Kenntnisse in einem konkreten Fall eigenständig anzuwenden (daher auch die zahlreichen Hinweise auf die genannte Software). 2. Sie sollten außerdem lernen, wie von anderen durchgeführte ökonometrische Berechnungen zu verstehen und zu beurteilen sind. Die vermittelten Methodenkenntnisse sind allgemein, so dass sie auf die Analyse der verschiedensten wirtschaftlichen Probleme (wie z.B. Fragen nach Ursachen und Abhängigkeiten, Prognosen) angewendet werden können, sofern hierfür zahlenmäßige Daten vorhanden sind, die methodisch korrekt auszuwerten sind. 3. Ein weiteres Ziel ist es, Studierende zu befähigen, sich jeweils selbst, je nach gestellter Aufgabe in die schnell wachsende und ständig komplizierter werdende Fachliteratur kompetent einarbeiten zu können (Selbstlernkompetenz) und diese hinsichtlich ihrer Eignung für das zu lösende Problem bewerten zu können. Hierfür sind die in der Vorlesung vermittelten Methodenkenntnisse eine notwendige Grundlage. Denn insbesondere die wissenschaftliche Literatur nimmt in immer größerem Maße auch auf komplizierte statistische und ökonometrische Betrachtungen Bezug. Eine fruchtbare und nicht zu lang dauernde Einarbeitung in die neuesten Analyseverfahren und die Entwicklung eigener Vorstellungen zu möglichen Verbesserungen ist kaum denkbar ohne eine entsprechende Einführung und Anleitung, die in dieser Veranstaltung gegeben wird. 	
Inhalt:	1.	Einführung: Gegenstand der Ökonometrie als Datenanalyse auf der Basis von Modellen (Gleichungen), Erklärung der Aufgabenfelder Modellbildung und Spezifikation, Schätzung, Hypothesentest und Prognose
	2.	Modell der Einfachen Regression: Modellannahmen, Methode der kleinsten Quadrate (und alternative Methoden wie Maximum Likelihood Methode, orthogonale Regression etc), Stichprobenverteilung von

		Schätzfunktionen, Punkt und Intervallschätzung, Gütekriterien einer Schätzung, Hypothesentests, Prognosen (Prognoseintervall), Konfidenzellipse
	3.	Multiple Regression: Modellannahmen, rekursive Beziehungen zwischen Regressions- und Korrelationskoeffizienten bei Hinzukommen weiterer Regressoren (stepwise regression), Schätzung (ordinary least squares OLS) einschl. Interpretation der entsprechenden Computerausdrucke, Tests für Hypothesen über die Parameter (Varianten des t- und F-Tests), Anpassungs- und Prognosegüte.
	4.	Verletzungen von Modellannahmen (Konsequenzen, Diagnose [Tests] und mögliche Abhilfen bei nicht erfüllten Annahmen) wie Fehlspezifikation, Nichtlinearität, Strukturbrüche, heteroskedastische, autokorrelierte und nicht normalverteilte Störgrößen, stochastische Regressoren und Multikollinearität. In diesem Abschnitt (Nr. 4) auch Hinweise auf logistische Regression, Hauptkomponentenanalyse etc.
	5.	Einführung in Mehrgleichungsmodelle: simultaneous equation bias, Methode der Instrumentvariablen, indirect least squares (ILS), Identifikationsproblem, two stage least squares (TSLS).
Literatur:	1.	Die Vorlesung ist eng angelehnt an das Lehrbuch: Ludwig von Auer: Ökonometrie, Eine Einführung, 4. Auflage, Berlin Heidelberg (Springer Verlag) 2007
	2.	Vom Dozenten sind speziell zu dieser Vorlesung zahlreiche Texte (Formelsammlung, Lehrtexte, Anwendungsbeispiele mit Eviews, über die Vorlesung hinausgehende weiterführende Texte) zum download im Internet zur Verfügung gestellt unter http://www.von-der-lippe.org/downloads2.php und auf der homepage von Prof. Dr. Anker.
	3.	Das Studium weiterer Bücher dürfte i.d.R. zum Verständnis der Vorlesung und zum Bestehen der Klausur nicht erforderlich sein. Es wird gegebenenfalls auf amerikanische Standardlehrbücher verwiesen.
Leistungsnachweis:	Klausur, Dauer: 60 Minuten	
Niveau:	Vertiefungsmodul	
Vorkenntnisse:	Aus der Deskriptiven Statistik (Statistik I) vor allem die Regressions- und Korrelationsanalyse und aus der Induktiven Statistik (und Wahrscheinlichkeitsrechnung, also Statistik II) Grundzüge der Schätz- und Testtheorie	
Arbeitsaufwand:	24 Stunden Vorlesung 96 Stunden Vor- und Nachbereitung	
Veranstaltungsart:	Vorlesung	
Veranstaltungssprache:	Deutsch	
Credits:	4	