



Universität Regensburg

Bachelor Phase 2

Schwerpunktmodul

**Empirische Wirtschaftsforschung**

10.12.2014

Prof. Dr. Rolf Tschernig

# Wozu Ökonometrie?

- Testen von (ökonomischen) Hypothesen
- Quantifizieren der Wirkung von Einflussfaktoren auf Zielgrößen (VWL, BWL, etc.)
- Prognosen erstellen
- Risiken quantifizieren
- Programme und Maßnahmen evaluieren

## Schwerpunktmodul Empirische Wirtschaftsforschung

Pflichtkurse	Theorie	Anwendungen	Sem.
<p>Ökonometrie II (Zeitreihendaten)</p> <p>[Rolf Tschernig]</p>	<p>Univariate Zeitreihenmodelle, Trends &amp; Saison, dynamische Regressionsmodelle, Unit- Root-Tests, Kointegration, robuste Standardfehler, Prognose</p>	<p>Phillips-Kurve, Börsenkurse, BIP, Biernachfrage, Regensburger Mietspiegel, Lohnregression, Konsumfunktion</p>	SS
<p>Ökonometrie III (Panel- und diskrete Daten, robuste Schätzer)</p> <p>[Rolf Tschernig]</p>	<p>Kausalität und Evaluations- studien, Paneldatenmodelle, Instrumentvariablenschätzer, simultane Gleichungs- systeme, Logit-/Probit- Modelle, Tobit-Modelle, Stichprobenverzerrungen</p>	<p>Fertilität, Müllverbrennungsanlage, Ausschussrate, Arbeitsmarktteilnahme, Lohnregression</p>	WS
<p>Quantitative Wirtschaftsforschung I</p> <p>[Sabine Klinger]</p>	<p>Univariate Zeitreihenmodelle, Multivariate Zeitreihenmodelle (VAR- Modelle), Nichtstationäre VAR-Modelle mit Kointegration</p>	<p>Taylor-Regel, IS-LM, Phillips- Kurve, Geldnachfrage</p> <p>Alle Veranstaltungen: 2 V + 2 Ü</p>	WS

## Schwerpunktmodul Empirische Wirtschaftsforschung

Wahlkurse	Inhalt	Dozent	Sem.
Immobilienökonomie I		Gabe Lee	SS
Regionalökonomie I	einfacher Modelle die optimale Preis- und Standortwahl von Unternehmen im Raum. Schätzen regionaler Marktpotentiale und des Einflusses ökonomischer Entfernung auf Handelsbeziehungen. Aktuelle Ergebnisse der regionalen Arbeitsmarktforschung!	Joachim Möller	SS
Wirtschaftsbeziehungen zu den Mittel- und Osteuropäischen Staaten		Christoph Knoppik	SS
Programmieren	Eviews, Programmieren mit R, Einführung in die computergestützte Datenanalyse mit STATA	Knoppik, Rameseder, Huber	SS, WS

Alle Veranstaltungen: 2 V + 2 Ü



## **Bachelorseminar**

- Eigene empirische Studie
- Ökonomischer Ansatz
- Datensuche
- Methodik
- Praktische Umsetzung
- Interpretation

# Warum weiter Ökonometrie?

Voraussetzung für empirische Analysen

- in anderen Kursen und Schwerpunktmodulen
- in Ihrer Seminararbeit,
- in Ihrer Bachelorarbeit

Voraussetzung zum Verständnis wie angewandte und politikorientierte Wirtschaftsforschung funktioniert:

- Z.B. in Wirtschaftsforschungsinstituten:
- ifo, DIW, RWI,

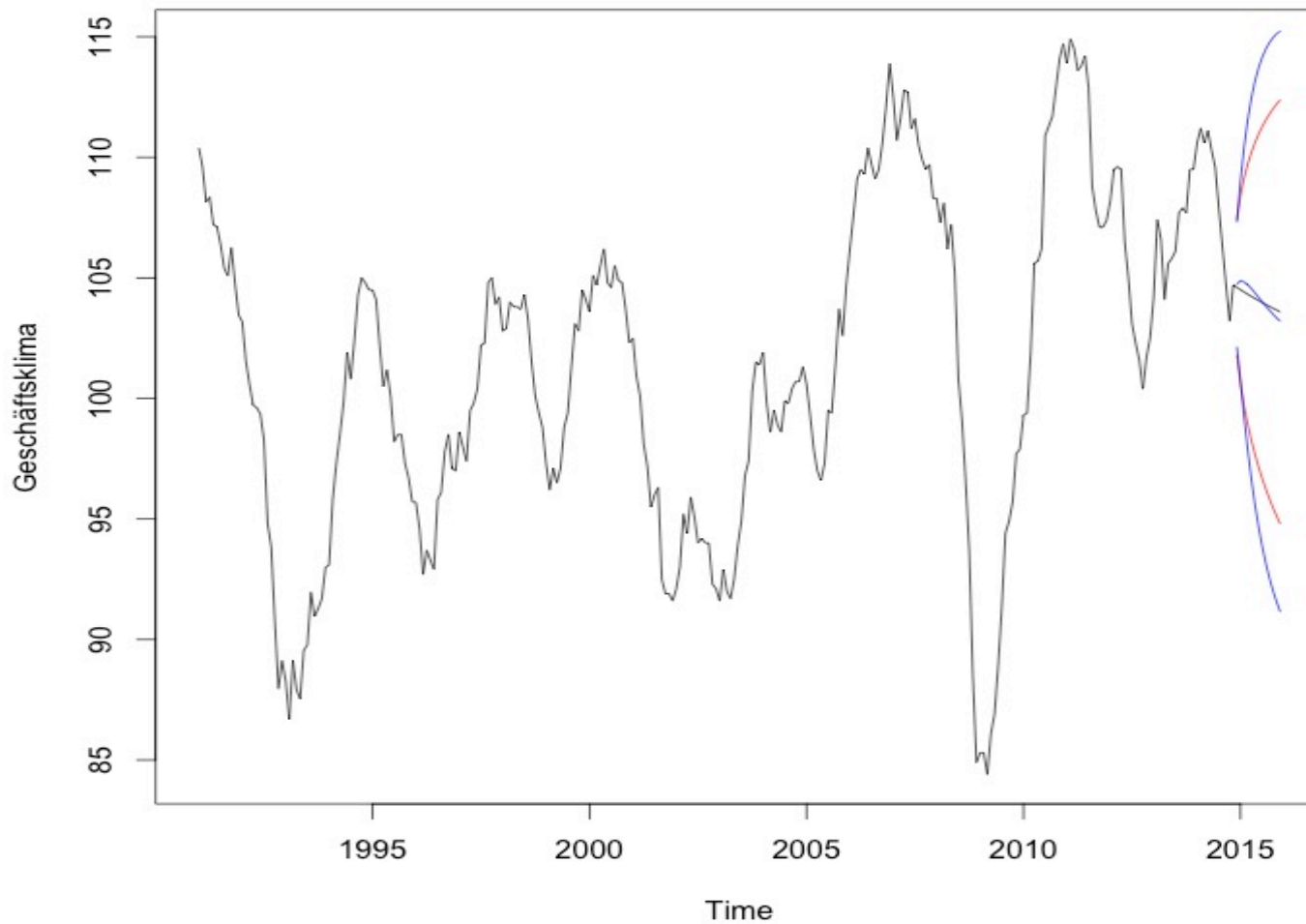
# Zwei Beispiele

- Vorhersage des ifo Geschäftsklima-Index
- Taylor-Regel

# Empirische Wirtschaftsforschung im (I)VWL Bachelor

## Vorhersage des ifo Geschäftsklima-Index

-> autoregressive Modelle -> Ökonometrie II





## Eine Regel zur Vermeidung von Inflation:

### Die Taylor-Regel

- Ziele der Zentralbank:
  - Inflationsziel → nah an der Zielinflation (EZB: 2 %)
  - Outputziel → gute Auslastung der Produktionskapazitäten, geringe Outputlücke
  - Zinsglättung → keine abrupten Zinssprünge, Orientierung am Zins der letzten Periode
- Also: wovon hängt der gesetzte Zins ab?

## Die Taylor-Regel

- Zins wird beeinflusst von
  - vergangenem Zins
  - Inflationsrate
  - Outputlücke
- Diese Einflüsse müssen wir quantifizieren!
- Informationen über:
  - Gewicht von Inflations- und Outputziel (EZB, Fed)
  - zweckmäßige Abbildung der Geldpolitik in aktuellen Modellen

→ Autoregressiver Prozess  
} dynamische Regression,  
} distributed lag model

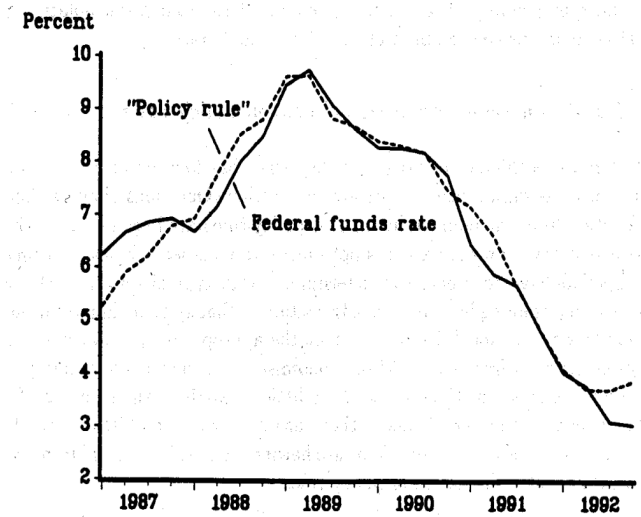


Figure 1. Federal funds rate and example policy rule.