



Panelökometrie

Schätzung linearer statischer und stationärer dynamischer Modelle

19. April 2012

8. Mai 2012

Schätzung nichtstationärer Modelle

20. April 2012

NEU

Schätzung binärer und zensierter Modelle

9. Mai 2012



Panelökonometrie

Schätzung linearer statischer und stationärer dynamischer Modelle

Panelökonometrische Verfahren gewinnen in der angewandten Forschung zunehmend an Bedeutung. Anhand dieser Verfahren werden statistische Daten ausgewertet, die sowohl über eine Querschnitts- als auch über eine Zeitdimension verfügen. Beispiele für Paneldatensätze sind das Sozio-ökonomische Panel, verschiedene Unternehmensdatensätze sowie viele Länderdatensätze von Eurostat, der OECD oder der Weltbank. Insbesondere werden panelökonometrische Verfahren zur Untersuchung mikroökonomischer Fragestellungen verwendet. Typische Anwendungsbeispiele sind die Schätzung der Arbeitsnachfrage von Unternehmen, des Arbeitsangebots von Einzelpersonen oder der ökonomischen Effekte von Schulbildung.

Das Seminar bietet Ihnen eine breit angelegte Einführung in die Methoden und Modelle der Panelökonometrie. Darüber hinaus werden praktische Fallbeispiele mit dem Softwarepaket Stata bearbeitet. Hierbei wird insbesondere ein Schwerpunkt auf die Interpretation der Ergebnisse gelegt.

Ihr Nutzen

- Sie erhalten eine Einführung in die Panelökonometrie und ihre Anwendungsmöglichkeiten in der empirischen Forschung.
- Sie lernen die Software Stata und ihre Anwendungsmöglichkeiten für Paneldaten kennen.
- Sie lernen diese Werkzeuge durch praktische Übungen am PC eigenständig zu nutzen.
- Sie erwerben Kritikfähigkeit gegenüber empirischen Studien mit einem Minimum an formalem Handwerkszeug.

Zielgruppe

Empirisch arbeitende Wirtschaftswissenschaftler in Unternehmen, Banken, Verbänden, Ministerien, Hochschulen und außeruniversitären Forschungseinrichtungen

Vorkenntnisse

Grundkenntnisse Ökonometrie (Inhalte, die durch das Seminar „Basistechniken I – Regressionsanalyse“ abgedeckt sind)

Programm

Donnerstag, 19. April 2012

Dienstag, 8. Mai 2012

Einführung, Grundmodelle der Panelökonometrie:

- Gepoolte Modelle
- Fixed-Effects-Modelle
- Random-Effects-Modelle

Dynamische lineare Paneldatenmodelle:

- Instrumentvariablenschätzer
- GMM-Differenzschätzer (Arellano-Bond)
- System-GMM-Schätzer (Arellano-Bover)
- Spezifikationstests

Einführung in die Panelökonometrie mit Stata und praktische Beispiele

Methoden

Vorträge, Beispiele und Übungen am PC

Referenten

Frieder Mokinski, ZEW

Dr. Bettina Peters, ZEW

Seminardatum, -zeit und -ort

- 19. April 2012, 9:00 bis 17:00 Uhr
ZEW · L 7, 1 · 68161 Mannheim
- 8. Mai 2012, 9:00 bis 17:00 Uhr
ZEW · L 7, 1 · 68161 Mannheim

Panelökonometrie

Schätzung nichtstationärer Modelle

Im Gegensatz zur mikroökonometrischen Panelanalyse treten bei makroökonometrischen Paneldatensätzen, die üblicherweise aus Länderdaten über lange Zeiträume bestehen, spezielle Probleme auf: trendbehaftete Datenreihen, hohe Autokorrelation, Einheitswurzeln oder Kointegration.

Das Seminar bietet Ihnen eine Einführung in diese Thematik, wobei neben der theoretischen Darstellung die praktische Anwendung mit dem Softwarepaket EViews im Vordergrund steht. In den praktischen Übungen werden globale Zins- und Produktionszusammenhänge untersucht. Auf Basis der erlernten Techniken werden Stabilitätsanalysen durchgeführt und es wird demonstriert, wie sich statistische Evidenz einzelner Ländermodelle zu einem Gesamteindruck kombinieren lässt.

Ihr Nutzen

- Sie lernen neue, aktuelle Techniken der angewandten Makroökonomie und ihre Interpretation kennen.
- Sie werden in die Lage versetzt, durch praktische Übungen am PC mit EViews diese Analysen eigenständig durchzuführen.

Zielgruppe

Empirisch arbeitende Wirtschaftswissenschaftler in Unternehmen, Banken, Verbänden, Ministerien und Forschungseinrichtungen

Vorkenntnisse

Grundkenntnisse Ökonometrie (Inhalte, die durch die Seminare „Basistechniken I – Regressionsanalyse“ und „Basistechniken II – Zeitreihenmodelle“ abgedeckt sind)

Methoden

Vorträge, Beispiele und Übungen am PC

Referenten

Prof. Dr. Uwe Hassler,
Johann Wolfgang Goethe-Universität Frankfurt am Main und ZEW
Dr. Marcus Kappler, ZEW

Seminardatum, -zeit und -ort

- 20. April 2012, 9:00 bis 17:00 Uhr
ZEW · L 7, 1 · 68161 Mannheim

Programm

Freitag, 20. April 2012

Integrationstests:

- Tests für integrierte und kointegrierte Zeitreihen
- Fehlerkorrekturmodelle

Panel-Daten in Eviews:

- Datenimport und deskriptive Analysen
- Ökonometrische Modelle

Panel-Integrationstests:

- LLC, IPS, Fischer-Test
- Taylor/Sarno
- KPSS-Test

Panel-Kointegration und Panel-Fehlerkorrektur

Panelökonometrie

Schätzung binärer und zensierter Modelle

Paneldaten haben in den vergangenen Jahren zunehmend an Bedeutung gewonnen. Dies lässt sich vor allem damit begründen, dass Paneldaten es erlauben, individuelle Unterschiede im Verhalten z.B. von Unternehmen oder Haushalten zu berücksichtigen. Darüber hinaus können dynamische Fragestellungen untersucht werden, selbst wenn nur wenige Beobachtungszeitpunkte vorliegen. In den Standardmodellen der Paneldatenökonometrie wird immer unterstellt, dass die zu erklärende Größe stetig ist. Dies trifft zum Beispiel für das Produktivitätswachstum oder Gewinne von Unternehmen zu. Für viele Fragestellungen ist dies jedoch eine ungeeignete Annahme. Dies gilt beispielsweise, wenn man Kaufentscheidungen oder den Status der Arbeitslosigkeit untersuchen möchte, da es sich in beiden Fällen um sogenannte binäre (0/1)-Entscheidungen handelt. Andere Methoden sollten auch dann zum Einsatz kommen, wenn die zu erklärende Größe zensiert ist, z.B. die Ausgaben für dauerhafte Haushaltsgüter, die nicht negativ werden können.

Das Seminar gibt Ihnen einen Überblick zu verschiedenen Modellen und Schätzmethoden für binäre und zensierte abhängige Variablen im Rahmen von Paneldaten. Darüber hinaus werden praktische Fallbeispiele mit dem Softwarepaket Stata bearbeitet. Hierbei wird insbesondere ein Schwerpunkt auf die Interpretation der Ergebnisse gelegt.

Ihr Nutzen

- Sie erhalten einen Überblick zu den Methoden für binäre und zensierte Variablen im Kontext von Paneldaten und ihren Anwendungsmöglichkeiten in der empirischen Forschung.
- Sie lernen die Software Stata und ihre Anwendungsmöglichkeiten für Paneldaten kennen.
- Sie lernen, diese Werkzeuge durch praktische Übungen am PC eigenständig zu nutzen.

Zielgruppe

Empirisch arbeitende Wirtschaftswissenschaftler in Unternehmen, Banken, Verbänden, Ministerien, Hochschulen und außeruniversitären Forschungseinrichtungen

Vorkenntnisse

Grundkenntnisse der Paneldatenökonometrie (Inhalte, die durch das Seminar „Panelökonometrie – Schätzung linearer statischer und stationärer dynamischer Modelle“ abgedeckt sind)

Methoden

Vorträge, Beispiele und Übungen am PC

Programm

Mittwoch, 9. Mai 2012

Schätzverfahren für statische Modelle mit binären abhängigen Variablen:

- Probit-Schätzer für das gepoolte Modell
- Logit-Schätzer für das gepoolte Modell
- Random-Effect-Probit-Schätzer
- Random-Effect-Logit-Schätzer
- Fixed-Effect-Logit-Schätzer
- Fallbeispiele mit Stata

Schätzverfahren für statische Modelle mit zensierten abhängigen Variablen:

- Tobit-Schätzer für das gepoolte Modell
- Random-Effect-Tobit-Schätzer
- Fallbeispiele mit Stata

Schätzverfahren für dynamische Modelle mit binären und zensierten abhängigen Variablen:

- Ansatz von Wooldridge
- Fallbeispiele mit Stata

Referentin

Dr. Bettina Peters, ZEW

Seminardatum, -zeit und -ort

- 9. Mai 2012, 9:00 bis 17:00 Uhr
ZEW · L 7, 1 · 68161 Mannheim

Referenten



Prof. Dr. Uwe Hassler, Research Associate am ZEW und Professor für Statistik und Methoden der Ökonometrie an der Universität Frankfurt am Main, nahm nach seiner Habilitation an der Freien Universität Berlin in den Fächern Statistik und Ökonometrie, Lehraufträge an der Ludwig-Maximilians-Universität München und an der Universität Münster wahr. Es folgte eine Professur an der TU Darmstadt.



Dr. Marcus Kappler, stellvertretender Leiter der Forschungsgruppe „Wachstums- und Konjunkturanalysen“, studierte an der Universität Tübingen, der University of Maryland, USA und der Freien Universität Berlin Volkswirtschaftslehre. Im Jahr 2007 wurde er an der Universität Frankfurt zum Dr. rer. pol. promoviert. In seiner Forschung beschäftigt er sich besonders mit der Genauigkeit von Konjunkturprognosen, der strukturellen Arbeitslosigkeit und den Einflussfaktoren des Produktionspotenzials.



Frieder Mokinski, Wissenschaftler im Forschungsbereich „Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement“, studierte Volkswirtschaftslehre an der Universität Konstanz mit den Schwerpunkten Ökonometrie und Unternehmensführung. Seit Januar 2010 arbeitet er als wissenschaftlicher Mitarbeiter am ZEW und beschäftigt sich dort schwerpunktmäßig mit der empirischen Untersuchung von Erwartungsbildungsprozessen.



Dr. Bettina Peters, Senior Researcher im Forschungsbereich „Industrieökonomik und Internationale Unternehmensführung“, studierte an der Universität Kiel Volkswirtschaftslehre mit den Schwerpunkten Ökonometrie und Statistik. Nach einer zweijährigen Mitarbeit an der Universität Kiel, wechselte sie im Jahr 2000 ans ZEW und beschäftigt sich dort vor allem mit der Analyse des Innovationsverhaltens von Unternehmen und des Mannheimer Innovationspanels. Im Jahr 2006 promovierte sie an der Universität Würzburg.

Allgemeine Informationen

Seminargebühr

Die Seminargebühr beträgt EUR 609,90 (EUR 570,- zzgl. 7% USt.) und beinhaltet Schulungsunterlagen, Pausen- und Veranstaltungsgetränke sowie das Mittagessen. Die Kosten für Anreise und Übernachtung trägt der Teilnehmer selbst. Weitere Kosten fallen nicht an. Die Teilnehmerzahl ist begrenzt.

Rabattsystem

Mehrfachbuchung: Das ZEW gewährt bei Buchung desselben Seminars durch verschiedene Mitarbeiter einer Institution einen Mengenrabatt von 10 Prozent ab dem zweiten Teilnehmer auf die reguläre Seminargebühr. Sollte ein Teilnehmer mehrere Seminare gleichzeitig buchen, erhält er ab dem zweiten Seminar 10 Prozent Rabatt auf die reguläre Seminargebühr. Diese Rabatte gelten nicht für Halbtagsveranstaltungen.

Sonderrabatt: Angehörige der WGL, von Universitäten, Fachhochschulen und außeruniversitären öffentlichen Forschungseinrichtungen, Angehörige von Bundes- und Landesministerien/-behörden sowie von der zuständigen Steuerbehörde nach § 52 Abgabenordnung (AO) anerkannte, gemeinnützige Organisationen erhalten 30 Prozent Rabatt auf die reguläre Seminargebühr.

Einzelne Rabatte sind nicht aufsummierbar.

Unsere Geschäfts- und Teilnahmebedingungen finden Sie unter www.zew.de/agbs

Anmeldung

Bitte melden Sie sich zur Seminarpartizipation über das Internet (www.zew.de/weiterbildung) an.

Seminarorganisation

Bei Fragen zur Seminarorganisation bzw. zu Übernachtungsmöglichkeiten wenden Sie sich bitte an Vera Pauli, Telefon: 0621/1235-124, Fax: 0621/1235-125, E-Mail: pauli@zew.de

Für unsere Teilnehmer sind Zimmerkontingente mit Sonderkonditionen in unseren Partnerhotels in ZEW-Nähe reserviert. Auf Wunsch übernimmt das ZEW Ihre Zimmerreservierung.

Qualifizierungsprogramm Ökonometrie

Das ZEW bietet neben diesen Veranstaltungen noch weitere Ökonometrie-Seminare an.

GRUNDKURSE ÖKONOMETRIE

Ökonometrie

Eine praxisorientierte Einführung

Basistechniken I

Regressionsanalyse

Basistechniken II

Zeitreihenmodelle

AUFBAUKURSE FINANZMARKTÖKONOMETRIE

Modellierung von Zinsen und Aktienkursen I

Vektor-Autoregressive Modelle

Modellierung von Zinsen und Aktienkursen II

Nichtstationäre Zeitreihen und Kointegration

Modellierung von Zinsen und Aktienkursen III

Erstellung von Prognosemodellen

AUFBAUKURSE PANELÖKONOMETRIE

Panelökonometrie

Schätzung linearer statischer und stationärer dynamischer Modelle

Panelökonometrie

Schätzung nichtstationärer Modelle

Panelökonometrie

Schätzung binärer und zensierter Modelle

Alle Seminare aus dem Qualifizierungsprogramm Ökonometrie können einzeln gebucht werden. Dies hat den Vorteil, dass Sie die einzelnen Seminare frei kombinieren und damit Ihr Programm nach Ihren individuellen Vorkenntnissen zusammenstellen können. Die Grundlagenkurse vermitteln Ihnen bei Bedarf die notwendigen Vorkenntnisse für die Aufbaukurse.

Weitere Informationen zu den Seminaren finden Sie unter www.zew.de/weiterbildung



Das ZEW arbeitet auf dem Gebiet der anwendungsbezogenen empirischen Wirtschaftsforschung. Seine zentralen Aufgaben sind die wirtschaftswissenschaftliche Forschung, die wirtschaftspolitische Beratung sowie der Wissenstransfer. Dabei wendet sich das Institut an Entscheider in Politik, Wirtschaft und Verwaltung, an Wissenschaftler im In- und Ausland sowie an die interessierte Öffentlichkeit.

Forschungsschwerpunkte des Instituts sind: Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement; Arbeitsmärkte, Personalmanagement und Soziale Sicherung; Industrieökonomik und Internationale Unternehmensführung; Unternehmensbesteuerung und Öffentliche Finanzwirtschaft; Umwelt- und Ressourcenökonomik, Umweltmanagement; Informations- und Kommunikationstechnologien; Wachstums- und Konjunkturanalysen; Wettbewerb und Regulierung.

Weitere Informationen erhalten Sie unter www.zew.de oder www.zew.eu und von der Presse- und Öffentlichkeitsarbeit des ZEW:

- Gunter Grittmann, Telefon: 0621/1235-132, E-Mail: grittmann@zew.de
- Kathrin Böhmer, Telefon: 0621/1235-103, E-Mail: boehmer@zew.de

Der Servicebereich „Wissenstransfer und Weiterbildung“

Das ZEW verfügt als einziges deutsches Wirtschaftsforschungsinstitut über einen eigenen Weiterbildungsbereich, um die Ergebnisse der wissenschaftlichen Forschungsarbeit des Instituts praxisnah an Fach- und Führungskräfte aus Unternehmen und Institutionen zu vermitteln. Die enge Kooperation zwischen Wissenschaftlern des ZEW und exzellenten Praktikern ermöglicht eine wissenschaftlich fundierte und zugleich praxisnahe Weiterbildung.

Das Angebot des ZEW gliedert sich in zwei Teile. Es umfasst zum einen Expertenseminare und zum anderen die spezifische Weiterbildung für Unternehmen und Institutionen.

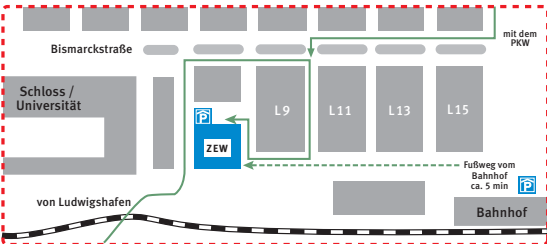
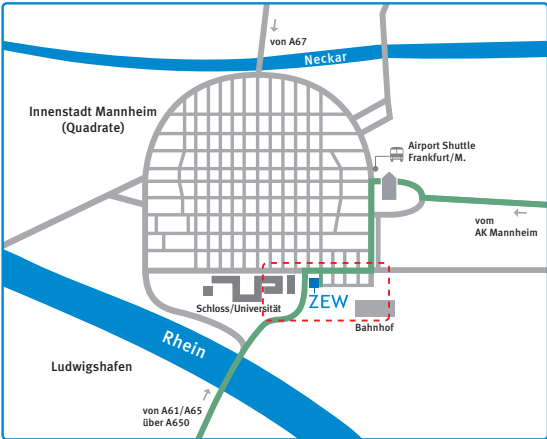
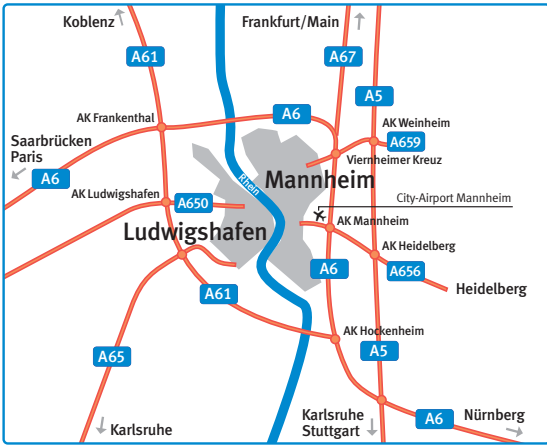
Expertenseminare

- Methodenkompetenz
- Qualifizierungsprogramm Ökonometrie
- Finanzmarktanalyse und -management
- Unternehmensführung und Organisation

Spezifische Weiterbildung für Unternehmen und Institutionen

- Methodenkompetenz
- Volkswirtschaftliche und betriebswirtschaftliche Kompetenz
- Kompetenzen in der Vermittlung von Soft Skills

Hinweis: Die verwendeten männlichen Bezeichnungen dienen ausschließlich der besseren Lesbarkeit und gelten ausdrücklich für beide Geschlechter.



ZEW

Zentrum für Europäische
Wirtschaftsforschung GmbH

L 7, 1 · 68161 Mannheim
 Postfach 103443 · 68034 Mannheim
 Telefon 0621/1235-01 (Zentrale)
 Telefax 0621/1235-224
 Internet www.zew.de · www.zew.eu