

Modulbeschreibung „Econometric Analysis of Longitudinal- and Panel Data“

(Fachgebiet Ökonometrie und Wirtschaftsstatistik,
Prof. Axel Werwatz Ph.D.)

Modulbeschreibung					
Kurzbezeichnung:	Titel des Moduls:				
	Deutsch: Längsschnitt- und Panelökonometrie				
	Englisch: Econometric Analysis of Longitudinal- and Panel Data				
Leistungspunkte (nach ECTS):	6	Workload in Std.:	180	Raum:	H 5103 C
Verantwortliche/-r für das Modul:	Prof. Axel Werwatz Ph.D.				
Dozent/in des Moduls	Prof. Axel Werwatz Ph.D.				
Sekretariat.:	Sekr. H57	Tel.:	030-314-23235	Fax.:	
Email:	axel.werwatz@tu-berlin.de	www.	http://www.statistik.tu-berlin.de		
Studierendenbetreuung (Tel.):	Sekr. H57 (Tel. 030-314-23235)				

1. Qualifikationsziele

Panel- and longitudinal data is the richest source of information on individuals, because it contains information on the behavior and outcomes of individuals (persons, households, plants, firms) over time. The models and methods covered in this course are designed to use the information in panel data: (1) to estimate relationships between observable variables that are not confounded by unobservable but time-constant heterogeneity ("ability") and (2) to study the dynamics and the persistence of individual behavior over time. The aim of this course is to enable students to apply (i.e. to specify, estimate and interpret) these models to analyze panel- and longitudinal data. Key ingredients of the course are the weekly tutorials that focus on hands-on experience in applying these methods to actual data in a computer classroom.

Das Modul vermittelt überwiegend die entsprechende Kompetenz, in % angegeben:

Fachkompetenz:	X	20	Methodenkompetenz:	X	80	Systemkompetenz:	<input type="checkbox"/>	Sozialkompetenz:	<input type="checkbox"/>
----------------	---	----	--------------------	---	----	------------------	--------------------------	------------------	--------------------------

2. Lehrinhalte

Linear Unobserved Effects Panel Data Model, Fixed-Effects-, Random-Effects- and First-Difference Methods, Nonlinear Unobserved Effects Panel Models: Binary Response Models for Panel Data. Dynamic Panel Data Models. The Generalized Method of Moments.

3. Modulbestandteile

LV-Titel	LV-Form	SWS	LP (nach ECTS)	P, WP	Semester (WS / SS)
Econometric Analysis of Longitudinal- and Panel Data	VL	2	4	P	WS
Econometric Analysis of Longitudinal- and Panel Data	UE	2	2	P	WS

4. Beschreibung der Lehr- und Lernformen

Vorlesung (VL) und Übung (UE). Übungen finden im PC-Pool statt, wo mit realen oder simulierten Daten und der ökonometrische Software STATA gearbeitet wird (Einführung in STATA zu Beginn des Kurses).

. Voraussetzungen für die Teilnahme	
a) obligatorisch:	Vorkenntnisse, die den Lehrinhalten des Moduls „Ökonometrie“ entsprechen und ggf. nachzuweisen sind. Bzw. erfolgreicher Abschluss dieses Moduls, sofern es im jeweiligen Studiengang zu belegen ist.
b) wünschenswert:	Es wird die erfolgreiche Absolvierung des Moduls „Mikroökometrie“ empfohlen..

6. Verwendbarkeit
Gemäß der Vorgaben und Möglichkeiten der StuPO des jeweiligen Studienganges.

7. Arbeitsaufwand und Leistungspunkte
Präsenz: 60 h, Vor- und Nachbereitung: 60 h, Prüfungsvorbereitung: 60 h → Gesamt-Arbeitsaufwand von 180h (=6 ECTS)

8. Prüfung und Benotung des Moduls
Prüfung: Schriftliche Prüfung. Benotung: Gemäß der StuPO des jeweiligen Studienganges.

9. Dauer des Moduls
Das Modul kann in 1 Semester(n) abgeschlossen werden.

10. Teilnehmer(innen)zahl
Die Teilnehmeranzahl ist nicht begrenzt.

11. Anmeldeformalitäten
Anmeldung Lehrveranstaltungsteilnahme: Bitte Angaben auf der Homepage beachten. Anmeldung Prüfung: Gemäß der StuPO des jeweiligen Studienganges bzw. gemäß Angabe auf der Homepage und in den Lehrveranstaltungen.

12. Literaturhinweise, Skripte			
Skripte in Papierform vorhanden?	<input type="checkbox"/>	Ist erhältlich bei:	
Skripte in elektronischer Form vorhanden	<input type="checkbox"/>	Auf der Internetseite:	
<u>Literatur:</u>			
<ul style="list-style-type: none"> • Wooldridge, J.M. (2001). Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, MIT Press. • Hsiao, C. (2005), Analysis of Panel Data, 2nd Edition, Cambridge University Press • Badi H. Baltagi (2005), Econometric Analysis of Panel Data , 3rd edition, Wiley & Sons • Arellano, M. (2003), Panel Data Econometrics, Oxford University Press • Lee, M.J., (2002), Panel Data Econometrics: Methods-of-Moments and Limited Dependent Variables, Academic Press • Fahrmeir, L. und Tutz, G. (2001), Multivariate Statistical Modelling Based on Generalized Linear Models, 2nd edition, Springer • Baum, C.F. (2006) An Introduction to Modern Econometrics Using STATA, Stata Press • Cleves, M., Gould, W. W. und Gutierrez, R. (2004), An Introduction to Survival Analysis Using STATA, Revised Edition, Stata Press 			

13. Sonstiges
Unterrichtssprache: Englisch (Vorlesung/Lecture), Deutsch oder Englisch (Übung/Tutorial)