

Master-Seminar SS 2025

Ökonometrische Modelle internationaler Wirtschaftsbeziehungen

Das Seminar hat zum Ziel, fortgeschrittene Master-Studierende bei der eigenständigen Durchführung ökonometrischer Analysen im Bereich internationaler Wirtschaftsbeziehungen zu begleiten. Dies ist insbesondere denjenigen Studierenden zu empfehlen, die planen, ihre Master-Arbeit am Lehrstuhl zu schreiben. Auf diesem Weg werden Fallstudien zu internationalen Wirtschaftsbeziehungen erarbeitet. Die besten Arbeiten dienen als Vorbild für Fallstudien (case studies). Deshalb wird die Struktur und Gliederung der Seminararbeiten bereits im Vorfeld detailliert vorgegeben. In den Standard-Lehrbüchern der Ökonometrie werden häufig ökonometrische Fallstudien verwendet, um die Anwendung der Methoden zu illustrieren. Diese haben jedoch relativ selten einen dediziert internationalen Bezug.

Vorkenntnisse sind erforderlich mindestens im Umfang der Veranstaltung „Einführung in die Ökonometrie“ sowie erste Erfahrungen im Umgang mit ökonometrischer Software und Programmpaketen, vorzugsweise mit R. Ferner sollte aus dem Kanon der Lehrveranstaltungen des Lehrstuhls mindestens entweder die Veranstaltung aus dem Wintersemester „Quantitative Modelle internationaler Wirtschaftsbeziehungen“ oder dem Sommersemester „International Capital Movements: Theory and Econometric Evidence“ besucht worden sein.

- 1) Das Seminar wird angeboten für Studierende der Studiengänge Master VWL, Master BWL - Energy and Finance sowie für den Master-Studiengang Märkte und Unternehmen.
- 2) Das Seminar wird in freier und individueller Form abgehalten. Das heißt, es gibt keine dedizierte Einführungssitzung und keine regelmäßigen Termine.
- 3) Nach Erhalt und Abgrenzung des Themas kann mit der Bearbeitung begonnen werden; nach ca. 1/3 der Bearbeitungszeit sollte ein Gliederungsgespräch stattfinden. Weitere Gespräche mit den Betreuern sind möglich, aber fakultativ.
- 4) Die Seminarvorträge werden im Verlauf des Wintersemesters 2025/26 im Rahmen der Übung zur Vorlesung „Quantitative Modelle internationaler Wirtschaftsbeziehungen“ abgehalten. Termine und Ort werden nach Abstimmung mit den Teilnehmern noch bekanntgegeben. Anmeldungen sind jedoch bereits ab sofort möglich bei Herrn M.A. Lennart Empting (R12 R07 A11). Terminliche Absprache per Mail.

- 5) Abgabe der Seminararbeiten in zweifacher Ausfertigung spätestens bis zum **30.09.2025** im Sekretariat des Lehrstuhls in Raum R12 R07 A05. Die Abgabe erfolgt in gedruckter Form auf Heftstreifen und elektronisch. Daten sowie workfiles oder R-Code müssen ebenfalls in elektronischer Form zur Verfügung gestellt werden. Der Umfang der Seminararbeit sollte bei etwa 20 Seiten reinem Text liegen. Die Arbeit kann in deutscher oder englischer Sprache verfasst werden.

Die nachfolgende Gliederung ist für alle Seminararbeiten verbindlich, wobei die Spiegelstriche entsprechende Hinweise für die inhaltliche Gestaltung geben:

1. Problemstellung

- Motivation, z. B. Relevanz oder Aktualität der Fragestellung
- Eingrenzung und Präzisierung der Fragestellung, Einordnung in die bestehende Literatur
- Gang der Untersuchung

2. Ökonomischer Hintergrund

- Wirtschaftstheoretische Modellierung, Herleitung von Schätzgleichungen aus der ökonomischen Theorie, ...

3. Ökonometrische Methodik

- Begründung der Schätzmethodik, Berücksichtigung evtl. Besonderheiten mit fortgeschrittenen Schätzverfahren, ...

4. Datenbasis

- Begründung der Auswahl der Daten, Transformationen der Zeitreihen, ...

5. Empirischer Befund

- Darstellung der Schätzergebnisse (graphisch und/oder tabellarisch)
- Diskussion der Schätzergebnisse

6. Zusammenfassung und Ausblick

- Zusammenfassung der zentralen Schätzergebnisse
- Ausblick auf weitere Untersuchungsdesigns/Sensitivitätsanalysen/Robustheit

Literaturverzeichnis

Anhänge

Programmcode in R: Wiedergabe des Programmcodes für die Schätzungen, **Datensatz in Excel-Tabelle,** ggfs. mit Erläuterungen zur Tabelle in .docx oder .txt Datei

Hinweise zur Recherche von ökonometrischen Fallstudien im Bereich Internationale Wirtschaftsbeziehungen

1. Lehrbücher zu internationalen Wirtschaftsbeziehungen mit ökonometrischen Fallstudien

- a) Robert Feenstra: Advanced International Trade, Cambridge University Press, 2nd ed. Cambridge 2015 (dort Anwendungen mit STATA, Datensätze vorhanden)
- b) Carlo Favero, Applied Macroeconometrics, Oxford University Press 2001 (Anwendungen mit EViews, etc.)

2. Lehrbücher zur Ökonometrie

- a) Einführende Lehrbücher (Bachelor), aber leider im Regelfall keine internationalen Bezüge
- b) Weiterführende Lehrbücher (Master); schon eher internationale Bezüge

3. Beiträge in anerkannten Fachzeitschriften mit Veröffentlichung von Datensätzen

- a) Beispiele: Romer D. H., Openness and Inflation: Theory and Evidence, Quarterly Journal of Economics, Vol. 108 (1993), p. 869-903. Daten finden sich dort im Anhang.

Boikos, S. , Panagiotidis, T., Serenidou, E. and Stengos, T. (2023) Revisiting the Mankiw et al. (1992) growth regressions, Economics and Business Letters, 12(3), 241-247. DOI: 10.17811/ebl.12.3.2023.241-247
- b) Übersichtsartikel, wie z. B. M. Duvendack, R. W. Palmer-Jones, W. R. Reed, Replications in Economics: A Progress Report, Econ Journal Watch, Vol. 12 (2015), p. 164-191.

4. Fallstudien anderer Ökonometrie-Software, z. B. RATS, PC GIVE, PC FIML STATA, R

Recherchen auf einschlägigen Internetseiten

5. Recherchen mit Suchmaschinen im Internet (Google, Yahoo, Google Scholar, ECONIS)

- a) Homepages renommierter Ökonominen und Ökonomen
- b) Eingabe „case study“ o. ä.

Strategien zur Abgrenzung ökonometrischer Projekte

Strategien lassen sich danach klassifizieren, welche der Komponenten - Theorie, Schätzmethodik, Daten - verändert wird. Der häufigste Fall ist, dass eine gegebene Theorie mit einer gängigen Schätzmethode auf einen neuen Datensatz angewendet wird (aktualisierte oder revidierte Daten, andere Länder oder Ländergruppen, ...). Der zweithäufigste Fall ist, eine neue Schätzmethodik zur Überprüfung einer bekannten Theorie mit einem bekannten Datensatz anzuwenden. Es ist auch nicht unüblich, ein bestehendes Untersuchungsdesign mit Theorie, Schätzmethodik, und Daten um eine weitere Einflussgröße zu erweitern. So wird ein Zusammenhang oft erst für geschlossene Volkswirtschaften untersucht und dann um außenwirtschaftliche Zusammenhänge, wie bspw. durch die Einbeziehung des Offenheitsgrades von Volkswirtschaften, erweitert. Dies gilt beispielsweise für die Beziehung zwischen der Unabhängigkeit von Zentralbanken und der Inflationsrate (siehe Beitrag von Romer, 1993).

Der erste Schritt ist der Versuch, die in einer Studie veröffentlichten Schätzergebnisse zu replizieren, um sicherzustellen, dass die ökonometrischen Ergebnisse korrekt ermittelt und die Schätzungen mit R (oder anderer Software) korrekt durchgeführt worden sind. Beim Versuch der Replikation der Ergebnisse findet man oft Hinweise auf eigene Verfahrens- oder Programmierfehler. Erstaunlich oft tritt allerdings auch auf, dass Ergebnisse selbst in anerkannten Fachzeitschriften veröffentlicht werden und dass sich im Nachhinein bei der Replikation herausstellt, dass von Seiten der Autoren Programmier- oder Dateneingabefehler gemacht worden sind. Vgl. dazu etwa *Dewald, W. G., J. G. Thursby, R.G. Anderson, Replication in Empirical Economics: The JMCB Project, The American Economic Review, Vol. 76 (1986), p. 587-603*. Weitergehende Informationen zu diesem Thema finden sich in *Hamermesh, D. S., Viewpoint: Replication in Economics, The Canadian Journal of Economics, Vol. 40 (2007), No. 3, p. 715-733*, *Chang, A. C., P. Li, Is Economics Research Replicable? Sixty Published Papers from Thirteen Journals Say "Usually Not", Federal Reserve Board, Finance and Economics Discussion Paper, No. 2015-08 (2015)* sowie in den Beiträgen von *Duwendack, M., R. W. Palmer-Jones und W. R. Reed (2015). "Replications in Economics: A Progress Report." Econ Journal Watch 12 (2): 164–91* und *Clemens, M. A., The Meaning of failed replications: A Review and Proposal, Journal of Economic Surveys (2017) Vol. 31, No. 1, pp. 326–342, doi: 10.1111/joes.12139*

Universität Duisburg-Essen, Campus Essen
Lehrstuhl für Internationale Wirtschaftsbeziehungen
Univ.-Prof. Dr. Volker Clausen

Fachseminar im Master-Programm
Internationale Wirtschaftsbeziehungen
SS 2025

[Thema der Seminararbeit]

vorgelegt von:

[Name, Vorname(n)].....

[Adresse]

Telefonnummer:

E-Mail-Adresse:

Matrikelnummer:

Betreuer: