

## **Master-Seminar SS 2010**

### **Ökonometrische Modelle internationaler Wirtschaftsbeziehungen**

Das Seminar hat zum Ziel, fortgeschrittene Studierende bei der eigenständigen Durchführung ökonometrischer Analysen im Bereich internationaler Wirtschaftsbeziehungen zu begleiten. Dies ist insbesondere denjenigen Studierenden zu empfehlen, die planen, ihre Abschlussarbeit am Lehrstuhl zu schreiben. Auf diesem Weg ist geplant, ökonometrische Fallstudien zu internationalen Wirtschaftsbeziehungen zu sammeln. Die besten Arbeiten sollen als Fallstudien im Internet zur Verfügung gestellt werden. Deshalb wird die Gliederung der Seminararbeiten bereits im Vorfeld detailliert vorgegeben. In den Standard-Lehrbüchern der Ökonometrie werden zwar häufig ökonometrische Fallstudien verwendet, um die Anwendung der Methoden zu illustrieren. Diese haben jedoch recht selten einen internationalen Bezug.

Vorkenntnisse sind erforderlich mindestens im Umfang der Veranstaltung Ökonometrie I sowie erste Erfahrungen im Umgang mit ökonometrischer Software, vorzugsweise mit EViews, wie sie beispielsweise in der Veranstaltung „Computergestützte Ökonometrie“ vermittelt werden. Ferner sollte entweder die Veranstaltung „Quantitative Modelle internationaler Wirtschaftsbeziehungen“ oder „Theorie und Empirie internationaler Kapitalallokation“ besucht worden sein.

- 1) Das Seminar wird angeboten für Studierende der Studiengänge VWL-Master, Master in Energie- und Finanzwirtschaft sowie für Diplom in Betriebswirtschaftslehre mit dem Wahlfach Internationale Wirtschaftsbeziehungen.
- 2) Das Seminar wird gegen Ende des Sommersemesters 2010 in Form eines Blockseminars abgehalten. Termine und Ort werden nach Abstimmung mit den Teilnehmern noch bekanntgegeben. Anmeldungen sind jedoch bereits ab sofort möglich bei Professor Clausen.
- 3) Abgabe der Seminararbeiten in zweifacher Ausfertigung spätestens bis zum 10. Juni 2010, 12.00 Uhr im Sekretariat des Lehrstuhls bei Frau Venghaus in Raum R12 R07 A05. Deckblatt als Muster wird am Ende dieses Dokuments zur Verfügung gestellt.

Nähere Informationen auf den Webseiten des Lehrstuhls.

Für alle Seminararbeiten verbindliche Gliederung, wobei die Spiegelstriche Hinweise für die inhaltliche Gestaltung geben :

**1) Problemstellung**

- Motivation, z. B. Relevanz oder Aktualität der Fragestellung
- Eingrenzung und Präzisierung der Fragestellung, Einordnung in die 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 fortgeschritteneren 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**

Darstellung der zentralen Schätzergebnisse  
Ausblick auf weitere Untersuchungsdesigns/Sensitivitätsanalysen

**Literaturverzeichnis**

**Anhänge**

**Programmcode in EViews:** Wiedergabe des Programmcodes für die Schätzungen

**Datensatz in Excel-Tabelle,** ggfs. mit Erläuterungen zur Tabelle in .doc od. .txt Datei

## Hinweise zur Recherche von ökonometrischen Fallstudien im Bereich Internationale Wirtschaftsbeziehungen

1. Lehrbücher zu internationalen Wirtschaftsbeziehungen mit ökonometrischem Bezug
  - a. Robert Feenstra: Advanced International Trade, Cambridge University Press, Cambridge 2004 (Anwendungen mit STATA)
  - b. Carlo Favero, Applied Macroeconometrics, Oxford University Press 2001 (Anwendungen mit EViews, etc.)
  
2. Lehrbücher zur Ökonometrie
  - a. Einführende Lehrbücher (undergraduate), (vgl. Hinweise unter [www.eviews.com](http://www.eviews.com)), aber im Regelfall keine internationalen Bezüge
  - b. Weiterführende Lehrbücher (graduate); schon eher internationale Bezüge
  
3. Beiträge in anerkannten Fachzeitschriften mit Veröffentlichung von Datensätzen  
Beispiel: D. H. Romer, Openness and Inflation: Theory and Evidence, Quarterly Journal of Economics, Vol. 108 (1993), p. 869-903. Daten im Anhang
  
4. Fallstudien anderer Ökonometrie-Software, z. B. RATS, PC GIVE, PC FIML STATA, Recherche auf einschlägigen Internetseiten
  
5. Recherchen mit Suchmaschinen im Internet (Google, Yahoo, Google Scholar)
  - a. Homepages renommierter Ökonomen, Beispiel: Gregory Mankiw  
<http://www.economics.harvard.edu/faculty/mankiw/data.html>
  - b. Eingabe „case study“ o. ä..

**Beispiel:** Fallstudie aus dem Unikate Heft zur Empirischen Wirtschaftsforschung Globalisierung und Wirtschaftswachstum, 2007

## **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, die über die ökonometrische Software zur Verfügung gestellt wird, 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 Analyse der Determinanten des Wirtschaftswachstums (siehe Beitrag im Unikate-Heft) oder 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 Ergebnisse korrekt ermittelt worden sind und die Eviews Schätzungen korrekt durchgeführt worden sind. Beim Versuch der Replikation der Ergebnisse findet man 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 Dewald, W. G., J. G. Thursby, R.G. Anderson, Replication in Empirical Economics: The JMCP Project, The American Economic Review, Vol. 76 (1986), p. 587-603). Weitergehende Informationen zu diesem Thema finden sich in D. S. Hamermesh, Viewpoint: Replication in Economics, The Canadian Journal of Economics, Vol. 40 (2007), No. 3, p. 715-733.

Universität Duisburg-Essen, Campus Essen

Lehrstuhl für Internationale Wirtschaftsbeziehungen  
Univ.-Prof. Dr. Volker Clausen

Fachseminar  
Internationale Wirtschaftsbeziehungen  
SS 2010

**[Thema der Seminararbeit]**

vorgelegt von:

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

[Adresse] .....

Telefonnummer: .....

E-Mail-Adresse: .....

Matrikelnummer: .....

Betreuer: