



**RUPRECHT-KARLS-UNIVERSITÄT HEIDELBERG**  
ALFRED-WEBER-INSTITUT FÜR  
WIRTSCHAFTSWISSENSCHAFTEN  
Professur für Empirische Wirtschaftsforschung  
Prof. Dr. Christian Conrad

Wintersemester 2022/23

**Advanced Econometrics**

<b>Vorlesung</b>	Di	9:00	12:00	HEU II
Übung	Mi	09:00	11:00	Neue Uni HS 09
Übung	Do	16:00	18:00	Neue Uni HS 09

Beginn: Dienstag, 18. Oktober 2022

*Kommentar:*

Die Vorlesung ist eine Pflichtveranstaltung für Studierende in allen fünf Spezialisierungsrichtungen des M.Sc. Economics. Der Vorlesungen und Übungen finden in Präsenz statt.

Die Veranstaltung gibt eine Einführung in die wichtigsten ökonometrischen Methoden zur Analyse von Querschnitts-, Panel- und Zeitreihendaten. Die Vorlesung wird durch methodische und empirische Übungen begleitet. Weitere Informationen sind auf der Moodle-Seite des Kurses verfügbar.

Vor Beginn des Semesters wird ein „Prep Course Econometrics“ angeboten, in dem die wichtigsten Konzepte der Wahrscheinlichkeitsrechnung, der induktiven Statistik sowie der Matrixalgebra wiederholt werden. Der Vorkurs wird in einem hybriden Format stattfinden. Weitere Informationen zum Vorkurs finden Sie [hier](#).

*Inhalt:*

1. The Linear Regression Model
2. Instrumental Variables Regression
3. Models for Panel Data
4. Experiments and Quasi-Experiments
5. Microeconometrics
6. Big Data
7. Time Series Regression
8. Carrying Out an Empirical Project

*Kurssprache:* Englisch

*Leistungsnachweis:*

Die Note für diese Vorlesung wird durch eine Klausur am Semesterende festgelegt. Es besteht die Möglichkeit, Zusatzpunkte durch die Abgabe von Aufgabenblättern zu erwerben.

*Literatur:*

Angrist, J.D., Pischke, J.-S., 2015. *Mastering 'Metrics': The Path from Cause to Effect*. Princeton University Press.

Angrist, J.D., Pischke, J.-S., 2009. *Mostly Harmless Econometrics. An Empiricists Companion*. Princeton University Press.

Cunningham, S., 2021. *Causal Inference: The Mixtape*. Yale University Press.

Greene, W. H., 2012. *Econometric Analysis*. Pearson.

Hansen, B. (2021). *Econometrics*.

Hayashi, F., *Econometrics*, 2000. Princeton University Press.

Stock, J. H., Watson, M. W., 2020. *Introduction to Econometrics*. Pearson.

Wooldridge, J. M., 2010. *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. MIT Press.

Wooldridge, J. M., 2019. *Introductory Econometrics*. Cengage Learning.