

Inhalte des Internen Forschungskolloquiums:

- Kurs: Einführung für neue Doktoranden*innen:
 - Einführung in empirische Methoden
 - In der ersten Phase lesen die Doktoranden*innen das Basis-Forschungspapier (W6270 IFK-EBF Beispiel-Forschungspapier) vollständig und verstehen insbesondere die theoretischen Zusammenhänge
 - Parallel dazu erarbeiten sie sich die für das Forschungspapier verwendeten Panel-Daten in der Excel-Datei (W6270 IFK-EBF Beispiel-Daten)
 - In der zweiten Phase werden die im Stata do-file (W6270 IFK-EBF Beispiel-do-file) formulierten Aufgaben sukzessive gelöst
 - Alle Doktoranden*innen lösen sämtliche Aufgaben und präsentieren ihre Lösungen im Rahmen des Doktorandenkolloquiums abwechselnd mithilfe von entsprechenden Slides
 - Die Inhalte der Aufgaben und Präsentationen werden anschließend in der Gruppe diskutiert

- Laufende Inhalte für alle Doktoranden*innen:
 - Identifikation von geeigneten Forschungsfragen für die Dissertationsprojekte
 - Fachliche Unterstützung im Rahmen der Forschungsprojekte (Empirische Methodik, Strukturierung des Papiers, wissenschaftliches Schreiben)
 - Präsentation der (Zwischen-)Ergebnisse aus den eigenen Forschungsprojekten durch die Doktoranden*innen und kritische Diskussion in der Gruppe
 - Hilfestellung bei der Einreichung des Forschungspapiers auf einschlägigen (inter-)nationalen Konferenzen und Journals mit Begutachtungsverfahren
 - Unterstützung bei der Gestaltung der Konferenz-Vortragsfolien
 - Besprechung von Journal-Reviews (eigene Reviews) und Durchführung von externen Reviews (Review Invitations)
 - Fachspezifische Vorträge von Gastwissenschaftlern
 - Gegenseitiger allgemeiner Austausch und Spaß an der empirischen Forschung

Inhalte der Einführung in empirische Methoden:

- Projektbeschreibung und Datenaufbau in Excel
- Datenanalyse in Stata
 - Outliers, Dummies, Interaktionsvariablen
 - Deskriptive Statistik, Korrelationsmatrix
 - Visual Inspections (Plots)
- Sukzessiver Aufbau der vorläufigen Schätzgleichung und die notwendige Diagnostik
 - Test auf Linearität
 - Test auf Multikollinearität
 - Test auf Homoskedastie
 - Test auf Normalverteilung
 - Test auf Autokorrelation (serielle Korrelation)
 - Test auf eine ausreichende Modellspezifikation (omitted variables)
- Lineare OLS Panelschätzer (Modellvergleich)
 - Pooled Regressions
 - Random-Effects Regressions
 - Fixed-Effects Regressions
- Lineare OLS Panelschätzer (Goodness-of-fit Tests)
 - Tests auf FE vs. RE
 - Test auf zeitfixe Effekte (time dummies)
 - Test auf gruppenweise Heteroskedastie (clustering)
 - Export von Stata in Word/Latex
- Robustness Tests
 - Einleitende Beispiele
 - Endogenität (Simultaneität, Reverse Causality)
 - Granger-causality tests
 - 2SLS Instrumentenvariable-Schätzer
- Sensitivity Analyses
- Weitere Schätzmodelle für Paneldaten
 - Dynamische Schätzer
 - Logistische Regressionen
 - Logit-Modell, Tobit-Modell, Probit-Modell
- Es werden nicht behandelt
 - Event-Study Techniken
 - Difference-in-Difference-Schätzer
 - Weitere spezifische Schätzmodelle für Paneldaten
 - (Anlassbezogene) Erarbeitung und Präsentation durch Doktoranden

Literatur:

Literatur zu ökonometrischen Methoden:

- Green, W.H. (2018): Econometric Analysis. Pearson, 8. Auflage.
- Wooldridge, J. (2016): Introductory Econometrics: A Modern Approach. Michigan State University Press, 6. Auflage.

Literatur zu ökonometrischen Methoden und deren Anwendung in Stata:

- Cameron, A.C., Trivedi, P.K. (2010): Microeconometrics Using Stata. Stata Press, 2. Auflage.

Literatur zu wiederkehrenden Themen des Empirical Banking:

- Beck, T., Casu, B. (2016): The Palgrave Handbook of European Banking. Macmillan, 1. Auflage.
- Berger, A.N., Molyneux, P., Wilson, J.O.S. (2019): The Oxford Handbook of Banking. Oxford University Press, 3. Auflage.

Literatur zu den Aufgaben des Einführungskurses:

- Uhde, A. (2020): Tax avoidance through securitization. The Quarterly Review of Economics and Finance. (W6270 IDK-EBF Beispiel-Forschungspapier)
- Nutzen Sie zur Lösung der Aufgaben des Einführungskurses „Einführung in empirische Methoden“ die o.g. angegebene Literatur
- Die in den Aufgaben verwendeten Stata-Befehle werden zudem in der Stata-Hilfe durch Eingeben von <help "Befehl"> in der Command-Zeile in Stata ausführlich erklärt
- Auch empfiehlt es sich, einzelne Aspekte im Stata-Forum (Statalist) nachzuschlagen / nachzulesen → <https://www.statalist.org/forums/>
- Ebenso bieten die Sektionen "Learn" und "Support" auf der Stata-Webseite eine gute Hilfestellung → www.stata.com