

**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](http://www.stata.com)