**Fixed vs Random Effects in Paneldatensätzen**

**Typ:** Seminar

**Semester:** WS 2014/2015

**Ort:**

**Zeit:** nach Absprache

**Dozent:** Dr. Höchstötter

**SWS:** 2

**LVNr.:**

**Leistungsanerkennung:** schriftliche Ausarbeitung, evtl. Datenauswertung

In der Ökonometrie spielen sogenannte Panel- oder Longitudinal-Datensätze eine große Rolle. Dabei handelt es sich um die Aggregation von Beobachtungen zu Merkmalen an einer Vielzahl von statistischen Einheiten über einen längeren Zeitraum. Das Ziel ist, durch Schätzung aus diesen Beobachtungen Rückschlüsse auf die einzelnen Einflüsse der Merkmale (Regressoren bzw. exogene Variable) auf eine Zielgröße (abhängige Variable) zu erhalten. Meist wird dem Zusammenhang eine lineare Natur unterstellt. Die Qualität der Schätzung wird nun ganz maßgeblich dadurch beeinflusst, welche Annahme man hinsichtlich der Grundgesamtheit macht; d.h. ob man mit der Stichprobe die Grundgesamtheit gänzlich erschöpft zu haben glaubt, oder ob es sich dabei eher um eine Untermenge derselben handelt. Entsprechend verwendet man in den Regressionen sogenannte ‚fixed‘ bzw. ‚random effects‘, um die einer statistischen Einheit inhärenten Charakteristika zu erfassen, die sich über die Zeit als invariant verhalten sollen. Die richtige Wahl dieser Effekte stellt Ökonomen in der Praxis immer wieder vor eine große Herausforderung.

**Literatur:**

1] Econometric Analysis, William Greene, 2008 (6.Ed.); Pearson, Prentice Hall.

2] weitere Literatur wird bekannt gegeben.

**Anmerkungen** Eine vorherige Anmeldung per Email an markus.hoechstoetter@kit.edu bzw. markus.hoechstoetter@partner.kit.edu wird erbeten.