

Probleme im linearen Modell oder was schiefgehen kann geht schief

Regressionsmodelle für Politikwissenschaftler

Wiederholung
Komplikationen
Schätzungen und ihre Eigenschaften
Annahmeverletzungen: Konsequenzen

Übersicht

Wiederholung

Komplikationen

Kategoriale Unabhängige

Interaktionen

Was tun mit nichtlinearen Zusammenhängen?

Schätzungen und ihre Eigenschaften

Wiederholung: Schätzungen

Eigenschaften von Schätzverfahren

Annahmeverletzungen: Konsequenzen

Was haben wir letzte Woche gelernt?

- ▶ Regression betrachtet den konditionalen Mittelwert einer Variablen
- ▶ In Abhängigkeit vom Niveau der unabhängigen Variablen folgt dieser Mittelwert einem Pfad
- ▶ Im klassischen linearen Modell entspricht dieser Pfad der Linie / Fläche / Hyperfläche, die die SAQ minimieren → partielle Ableitungen auf null setzen
- ▶ Das Gleichungssystem, mit dessen Hilfe b_0, b_1, \dots gefunden werden, läßt sich mit Hilfe von etwas Matrix-Algebra sehr effizient analytisch lösen
- ▶ Datenmatrix muß genug unabhängige Informationen enthalten → keiner der Spaltenvektoren darf Linearkombination anderer Vektoren darstellen (perfekte Kollinearität)
- ▶ Mittel zur Datenverdichtung – ist OLS aber auch ein guter Schätzer für die unbekannt Parameter der Grundgesamtheit?

Regressionsmodelle für Politikwissenschaftler

Probleme im linearen Modell

Kategoriale Unabhängige
Interaktionen
Was tun mit nichtlinearen Zusammenhängen?

Vorab: Komplikationen

- ▶ Auf welche Komplikationen sind wir letzte Woche gestoßen?
1. Kategoriale unabhängige Variablen
 2. Interaktionen
 3. Nicht-lineare Zusammenhänge

Regressionsmodelle für Politikwissenschaftler

Probleme im linearen Modell

Was tun mit kategorialen Unabhängigen?

- ▶ Keine Verteilungsannahmen für die unabhängigen Variablen?
- ▶ Unabhängige Variablen können kategorial sein
- ▶ Gar kein Problem bei dichotomen Variablen → 0/1 kodieren (Dummies)
- ▶ Effekt entspricht der Differenz zwischen den Mittelwerten von Gruppe 0/1
- ▶ Identisch mit t-Test für unabhängige Stichproben

Was tun mit kategorialen Unabhängigen?

- ▶ Nominale Variablen mit $k > 2$ Kategorien durch $k - 1$ Dummies repräsentieren
- ▶ Beispiel Konfession mit Kategorien katholisch / protestantisch / andere durch kath/prot oder kath/andere oder prot/andere
- ▶ Warum nicht drei Dummies?

y	p	k	a
12	1	0	0
13	0	1	0
10	0	0	1
11	0	1	0
14	1	0	0

- ▶ Jeweils einer der drei Vektoren \mathbf{p} , \mathbf{k} , \mathbf{a} perfekte Linearkombination der anderen beiden z. B. $\mathbf{a} = \mathbf{1} - \mathbf{p} - \mathbf{k}$
- ▶ (Perfekte) *Kollinearität*
- ▶ Matrix $\mathbf{X}'\mathbf{X}$ nicht invertierbar
- ▶ In Normalgleichungen mehr Unbekannte als voneinander unabhängige Normalgleichungen
- ▶ Information redundant; einen beliebigen Dummy weglassen

y	p	k	a
12	1	0	0
13	0	1	0
10	0	0	1
11	0	1	0
14	1	0	0

- ▶ Die weggelassene Kategorie heißt „Referenzgruppe“
- ▶ Konstante plus gegebenenfalls Effekte anderer Variablen = erwarteter Wert für Referenzgruppe
- ▶ Effekte der übrigen Kategorie entsprechen der Abweichung dieser Gruppen vom Wert der Referenzgruppe
- ▶ $y = 10 + 3p + 2k$
- ▶ $y = 12 + 1p - 2a$
- ▶ $y = 13 - 1k - 3a$
- ▶ Verfahren entspricht Varianzanalyse (auch andere Kodierungen möglich)

Wie kommt es sonst zu perfekter Kollinearität?

- ▶ Kodierungsfehler
- ▶ Kohortenanalyse (APK-Ansatz)
- ▶ Abhängige Variable wird beeinflusst von
 - ▶ Alter des Befragten
 - ▶ Periode (Zeitpunkt der Untersuchung)
 - ▶ Kohorte (Generation)
- ▶ Z. B. in Nichtwählerstudien
- ▶ Aber: $A = P - K$, $P = K + A$, $K = P - A$
- ▶ Lösungen
 - ▶ (Willkürliche) Restriktionen
 - ▶ Eine oder mehrere Variablen durch Inhaltliches ersetzen

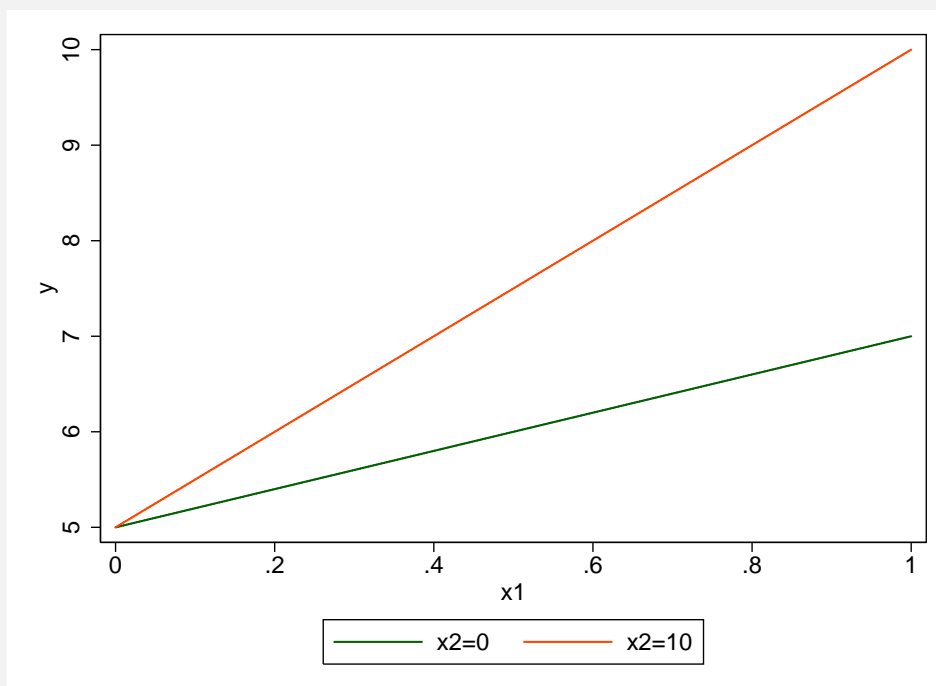
Was ist ein Interaktionseffekt?

- ▶ Standardmodell geht davon aus, daß unabhängige Variablen additiv zusammenwirken
- ▶ Effekt von x_1 vom Niveau von $x_2 \dots$ unabhängig
- ▶ Diese Annahme wird bei Interaktionen aufgegeben:
 - ▶ Effekt von x_1 hängt vom Niveau von x_2 ab und umgekehrt
 - ▶ Durch Produktterm ($x_1 \times x_2$) modelliert
 - ▶ b_1 und b_2 müssen jetzt konditional interpretiert werden
 - ▶ b_1 entspricht der Wirkung von x_1 wenn $x_2 = 0$ und umgekehrt

Ein Beispiel?

► $y = 5 + 2x_1 + 3x_2 + 0,3x_1x_2 + \epsilon$

Ein Beispiel?



Signifikanz von Interaktionseffekten

- ▶ Koeffizient für multiplikativen Interaktionsterm = 0 → keine Interaktion in GG?
- ▶ Koeffizient entspricht Differenz zwischen Effekt von x_1 für verschiedene Niveaus von x_2 (oder umgekehrt)
- ▶ Beliebige lineare Transformationen von x_1 und x_2 zulässig → Signifikanz des Koeffizienten kann beliebig manipuliert werden
- ▶ Lösung: Stärke und Signifikanz des Effekte von x_1 für verschiedene Niveaus von x_2 berechnen/plotten und umgekehrt

Was sind nicht-lineare Effekte?

- ▶ In manchen (wenigen) Fällen ist die Linearitätsannahme offensichtlich unplausibel
- ▶ Z. B. kurvilinearere Zusammenhang zwischen Alter und Rechtsextremismus
- ▶ Wenn gute theoretische Begründung vorhanden, können Transformationen von y und/oder x sinnvoll sein, die den Zusammenhang zwischen beiden linearisieren
- ▶ In diesem Fall ist OLS unproblematisch
- ▶ Verwendet werden normalerweise das Quadrat, die Quadratwurzel, deren Kehrwerte und der natürliche Logarithmus („ladder of powers“)
- ▶ Tendenziell: Vorsicht

Was wird wie geschätzt?

- ▶ OLS ist zunächst ein Verfahren, um eine Linie / Fläche / Hyperfläche durch eine Punktwolke zu legen
- ▶ Wenn Voraussetzungen erfüllt ist, ist OLS darüber hinaus ein gutes *Schätzverfahren*
- ▶ Schluß von Stichprobe auf Grundgesamtheit
- ▶ Das Stichprobenwerte als Schätzung für Parameter der Grundgesamtheit dienen können, ist nicht selbstverständlich
- ▶ Z. B. unterschätzt Stichprobenvarianz Varianz in der Grundgesamtheit

Was sind nochmal Standardfehler?

- ▶ Gedankenexperiment: Aus einer großen Grundgesamtheit immer wieder unter essentiell identischen Bedingungen Stichproben gleicher Größe ziehen
- ▶ Mit OLS Koeffizienten des Modell berechnen
- ▶ Über eine unendliche Zahl von Wiederholungen hinweg *Verteilung* (mit Mittelwert, Varianz) für jeden Parameter
- ▶ Außerdem Kovarianzen zwischen den Schätzungen, wenn diese nicht völlig unabhängig voneinander sind
- ▶ Zu jeder Modellschätzung gehört Varianz-Kovarianz-Matrix
- ▶ Standardfehler: Quadratwurzel aus Varianz des Parameters (über unendlich viele Stichproben hinweg)

Von was hängt Standardfehler ab?

- ▶ Formel für Varianz der Schätzungen im bivariaten Fall:

$$V(b_1) = \frac{\sigma_\epsilon^2}{\sum (x_i - \bar{x})^2}$$

- ▶ Was bedeutet das in Worten?
- ▶ Varianz / Standardfehler umso größer, je größer Varianz von ϵ
- ▶ Wenn $V(\epsilon) = 0$ liegen in der Grundgesamtheit alle Punkte exakt auf der Geraden → kein Stichprobenfehler möglich
- ▶ Varianz / Standardfehler umso kleiner, je größer die SAQ_x
 - ▶ Präzisere Schätzungen mit größeren Stichproben
 - ▶ Präzisere Schätzungen, wenn mehr Varianz von x (mehr Information)
 - ▶ Keine Schätzung möglich, wenn x nicht variiert

Von was hängt Standardfehler ab?

- ▶ Formel für die Varianz der Schätzungen im multivariaten Fall:

$$V(b_j) = \frac{1}{1-R_j^2} \times \frac{\sigma_\epsilon^2}{\sum_{i=1}^n (x_{ij} - \bar{x}_j)^2} \text{ mit } j \neq 0$$

- ▶ beziehungsweise in Matrix-Schreibweise $\mathbf{V} = \sigma_\epsilon^2 \times (\mathbf{X}'\mathbf{X})^{-1}$
- ▶ \mathbf{V} ist die Varianz-Kovarianz-Matrix, Quadrate der Standardfehler auf der Hauptdiagonalen
- ▶ Was bedeutet das in Worten?
- ▶ Wenn ein x mit allen anderen x unkorreliert ist, bleibt alles wie zuvor
- ▶ Ansonsten Standardfehler umso größer, je enger lineare Zusammenhänge zwischen den x
- ▶ Lineare Abhängigkeiten machen Schätzungen unpräzise, im Extremfall sogar unmöglich

Welche Eigenschaften sind wichtig?

- ▶ Häufig werden drei Eigenschaften von Schätzverfahren betrachtet:
 1. (Asymptotische) Verzerrung (Bias)
 2. (Asymptotische) Effizienz
 3. Konsistenz
 4. (Suffizienz)

Was bedeutet Verzerrung (Bias)?

- ▶ Der Mittelwert der Stichprobenkennwertverteilung (Verteilung der $b \dots$)
- ▶ soll mit dem wahren Parameter β zusammenfallen
- ▶ Wichtig, aber nicht um jeden Preis: Was nützt geringer bias, wenn Varianz der Schätzungen sehr hoch ist?
- ▶ Eventuell ist ein geringer bias ein akzeptabler Preis für kleine Varianz
- ▶ Mean Squared Error (MSE) = $(\text{bias})^2 + V$
- ▶ Asymptotisch = auf große Stichproben bezogen; asymptotisch unverzerrt = bias geht gegen null, wenn Stichprobenumfang gegen unendlich geht
- ▶ Generelles Problem: σ^2 in der Regel unbekannt, muß aus Residuen (e) geschätzt werden

Was bedeutet Effizienz?

- ▶ Relatives Konzept
- ▶ Bezieht sich auf Varianz der Schätzungen
- ▶ Unter allen unverzerrten Schätzern ist der mit der geringsten Varianz der effizienteste
- ▶ Effizienz ist der Kehrwert des MSE

Was bedeutet Konsistenz?

- ▶ $\hat{\beta}_n$ ist ein Schätzer für β bei einem Stichprobenumfang von n
- ▶ Konsistenz heißt: Wenn ich für n immer größere Werte wähle . . .
- ▶ kann ich die Wahrscheinlichkeit, daß $\hat{\beta}_n$ um mehr als einen trivialen Betrag von β abweicht . . .
- ▶ beliebig nahe an null heranbringen
- ▶ Wenn bias und Varianz der Schätzung bei steigender Fallzahl gegen null streben, ist das eine hinreichende Bedingung für Konsistenz

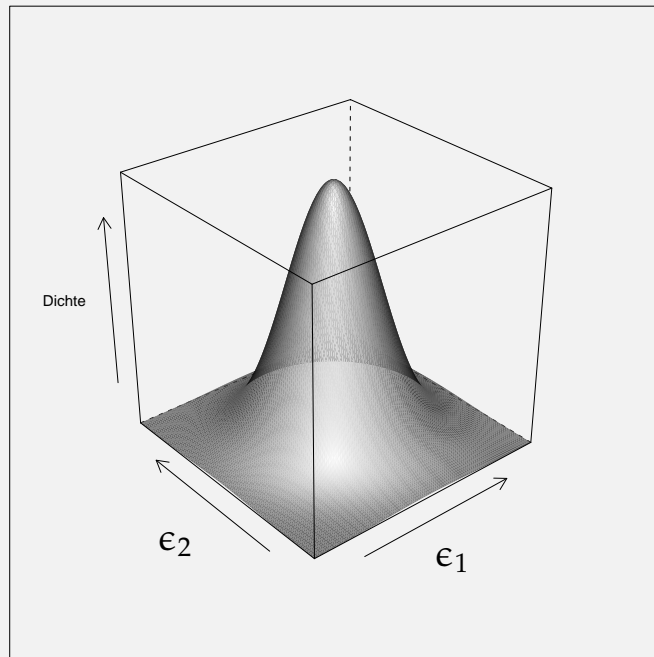
Welche Annahmen treffen wir?

- ▶ OLS ist unverzerrter und effizienter Schätzer, wenn eine Reihe von Annahmen erfüllt ist:
- 1. Die unabhängige Variable ist intervallskaliert und unbeschränkt. Variablen werden ohne Fehler gemessen
- 2. Alle unabhängigen Variablen haben Varianz
- 3. Keine perfekte Multikollinearität
- 4. Für jede mögliche Kombination der unabhängigen Variablen ist der (konditionale) Mittelwert von $\epsilon = 0$
- 5. Keine Kovarianz zwischen x_i und ϵ
- 6. Für jedes beliebige Paar von Beobachtungen i und h sind ϵ_i und ϵ_h unkorreliert (keine Autokorrelation)
- 7. Für jede mögliche Kombination der unabhängigen Variablen ist die (konditionale) Varianz von ϵ gleich σ^2 und damit konstant (Homoskedasizität)
- 8. Für jede mögliche Kombination der unabhängigen Variablen ist ϵ normalverteilt

Was bedeutet „i.i.d.“?

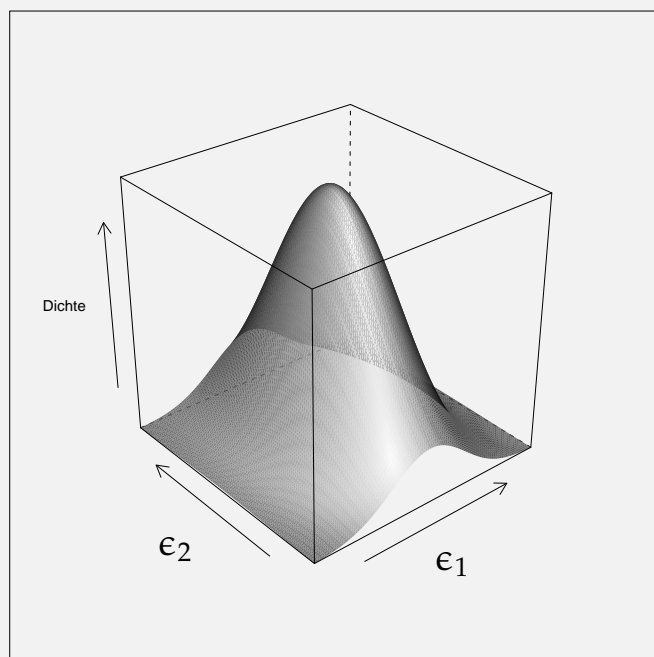
- ▶ Bedingungen 6 und 7 werden auch als „independently and identically distributed“ (i.i.d.) bezeichnet
- ▶ **Wie können zwei einzelne Werte eine (bzw. zwei) Verteilungen haben?**
- ▶ **Wie können zwei einzelne Werte („Fehler“, ϵ) eine Korrelation/Kovarianz haben?**
- ▶ Z.B. Fall 1 und Fall 2
 - ▶ Stichprobenziehung wiederholt → andere Fälle bzw.
 - ▶ Sozialer Prozeß läuft weiter → neue Fälle
 - ▶ Jeweils mit einem zufälligen Einfluß, der aus einer separaten Standardverteilung gezogen wird
 - ▶ Diese *Verteilungen* sind unabhängig (keine Kovarianz) und haben identische Varianz

i.i.d.



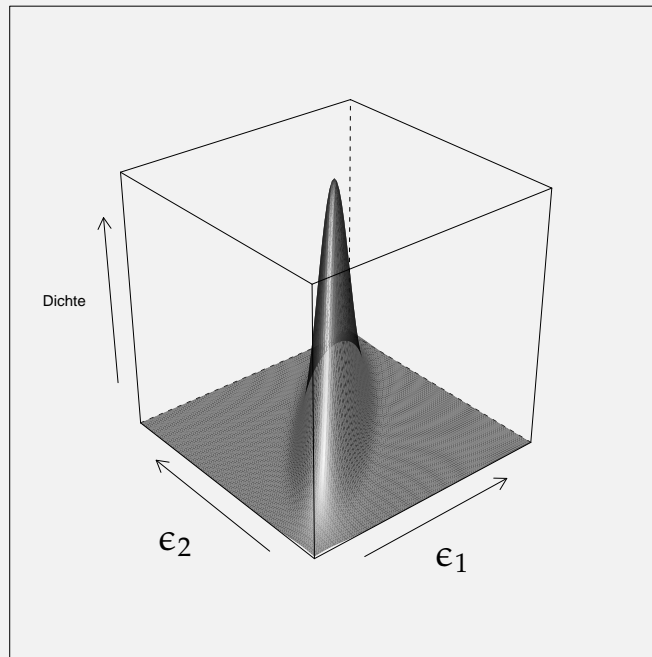
$$\hat{\epsilon}_1 = \hat{\epsilon}_2 = 0, V(\epsilon_1) = V(\epsilon_2) = 1, \text{cov}(\epsilon_1, \epsilon_2) = 0$$

Heteroskedastizität



$$\hat{\epsilon}_1 = \hat{\epsilon}_2 = 0, V(\epsilon_1) = 1, V(\epsilon_2) = 3, \text{cov}(\epsilon_1, \epsilon_2) = 0$$

„Fehler“ (ϵ) nicht unabhängig



$$\hat{\epsilon}_1 = \hat{\epsilon}_2 = 0, V(\epsilon_1) = V(\epsilon_2) = 1, \text{cov}(\epsilon_1, \epsilon_2) = 0.9$$

Was passiert, wenn Annahme 1 nicht erfüllt ist?

„Die unabhängige Variable ist intervallskaliert und unbeschränkt. Variablen werden ohne Fehler gemessen“

- ▶ Abhängige Variable hat häufig wenig diskrete Ausprägungen (Ratingskalen)
 - ▶ Erwartete Werte außerhalb des gültigen Wertebereichs
 - ▶ Annahme eines linearen Zusammenhangs, obwohl tatsächlich nicht-linear → Modelle für ordinale Daten
 - ▶ In der Literatur wenig diskutiert, häufig wird angenommen, daß Modell relativ robust ist
- ▶ Alle sozialwissenschaftlichen Variablen fehlerbehaftet
 - ▶ Relativ unproblematisch, wenn Fehler voneinander unabhängig
 - ▶ Zusätzliche Unsicherheit, bei großen Stichproben kein großes Problem
 - ▶ Fehler bei y wird von ϵ absorbiert, OLS weniger effizient
 - ▶ Fehler bei x schwächt im bivariaten Fall Zusammenhang ab, multivariat auf jeden Fall bias
 - ▶ Kann z. B. mit Strukturgleichungsmodellen explizit modelliert werden


Was passiert, wenn Annahme 2 nicht erfüllt ist?

„ Alle unabhängigen Variablen haben Varianz“

- ▶ Inhaltlich: Falls die betreffende Variable einen Effekt hat, wird dieser nicht sichtbar
- ▶ Mathematisch: Division durch 0, Standardfehler nicht definiert

Was passiert, wenn Annahme 3 nicht erfüllt ist?

„ Keine perfekte Multikollinearität“

- ▶ Oben diskutiert, keine eindeutige Lösung für Gleichungssystem
- ▶ Bei nicht perfekter Kollinearität große Standardfehler 
- ▶ Eventuell numerische Instabilität
- ▶ Eng korrelierte Variablen durch Index oder Faktor ersetzen
- ▶ Möglichst keine überflüssigen Variablen im Modell, vor allem wenn Fallzahl klein, da OLS ansonsten ineffizient
- ▶ Problem? Möglichst alle relevanten Variablen müssen in das Modell
- ▶ Das sind Variablen, die Einfluß haben, Einfluß haben könnten, in Beziehung mit anderen relevanten Variablen stehen

Warum müssen alle relevanten Variablen ins Modell?

- ▶ Wenn x_1 und x_2 unkorreliert sind, ist Schätzung für β_1 unverzerrt, auch wenn x_2 nicht berücksichtigt wird
- ▶ Aber: Wenn Korrelation zwischen x_1 und x_2 ungleich null, sind Schätzungen verzerrt (Drittvariablenproblem)
- ▶ Kein Problem bei echten Experimenten mit Randomisierung (warum?)
- ▶ Ansonsten: Möglichst viele mögliche unabhängige Variablen berücksichtigen?!?

Was passiert, wenn Annahme 4 nicht erfüllt ist?

„Für jede mögliche Kombination der unabhängigen Variablen ist der (konditionale) Mittelwert von $\epsilon = 0$ “

- ▶ Wird u. a. verletzt, wenn Stichprobe bei Auswahl verzerrt wird (Beispiel im Text)
- ▶ Falls Mittelwert von ϵ für alle Kombinationen um einen konstanten Betrag größer oder kleiner als null, wird Differenz von Konstante absorbiert → verzerrte Schätzung für Konstante
- ▶ Ansonsten Linearitätsannahme verletzt, relevante Variable ausgelassen beziehungsweise Korrelation zwischen ϵ und x
- ▶ Verzerrte Schätzungen für alle Parameter

Was passiert, wenn Annahme 5 nicht erfüllt ist?

„Keine Kovarianz zwischen x_i und ϵ “

- ▶ Vorsicht: Residuen sind nur Hilfsmittel zur Schätzung von ϵ
- ▶ Residuen und unabhängige Variablen sind immer unkorreliert (Eigenschaft des OLS-Verfahrens) → kein Rückschluß möglich
- ▶ Annahme 5 garantiert nicht erfüllt wenn wechselseitige Kausalwirkung zwischen y und x (Endogenität)
 - ▶ Wenn y von x und ϵ beeinflusst wird und
 - ▶ y zugleich einen Einfluß auf x hat dann garantiert
 - ▶ Zusammenhang zwischen x und ϵ
- ▶ In der Konsequenz identisch mit dem Auslassen relevanter Variablen (sofern diese nicht mit den übrigen x unkorreliert sind)
→ Schätzungen sind verzerrt
- ▶ Spezielle Modelle/Schätzverfahren, „Instrumente“

Was passiert, wenn Annahme 6 nicht erfüllt ist?

„Für jedes beliebige Paar von Beobachtungen i und h sind ϵ_i und ϵ_h unkorreliert (keine Autokorrelation)“

- ▶ ϵ beinhaltet (1) genuin zufällige Einflüsse und (2) solche Einflüsse, die so schwach sind, daß sie als zufällig betrachtet werden
- ▶ Vor allem bei Zeitreihendaten ist es unwahrscheinlich, daß Einflüsse zwischen zwei Meßpunkten vollständig verschwinden
 - ▶ auf überdurchschnittliche Werte folgen überdurchschnittliche Werte
 - ▶ auf unterdurchschnittliche Werte folgen unterdurchschnittliche Werte
- ▶ Für zwei beliebige Meßpunkte t und $t + 1$ sind ϵ_t und ϵ_{t+1} zwei Zufallsvariable mit
 - ▶ einem Mittelwert von null
 - ▶ einer positiven Korrelation

Wie kann es noch zu Autokorrelation kommen?

- ▶ Wiederholte Messungen an derselben Einheit (Panel)
- ▶ Räumliche Korrelation (Klumpenstichproben)
- ▶ Autokorrelation ist immer dann zu erwarten, wenn die Daten strukturiert sind
- ▶ Was sind die Konsequenzen? Noch einen Moment Geduld

Was passiert, wenn Annahme 7 nicht erfüllt ist?

„Für jede mögliche Kombination der unabhängigen Variablen ist die (konditionale) Varianz von ϵ gleich σ^2 und damit konstant (Homoskedasizität)“

- ▶ Impliziert: Konditionale Varianz von y ist ebenfalls für jede mögliche Kombination der unabhängigen Variablen konstant gleich σ^2
- ▶ Beispiele aus dem Text: Meßfehler hängt vom Niveau der unabhängigen Variablen ab (Gewicht von Personen, Entwicklungsstand von Ländern) → Korrelation zwischen x und $V(\epsilon)$
- ▶ Liegt manchmal aufgrund inhaltlicher Überlegungen nahe (Beispiel Familieneinkommen / Ausgaben für Urlaub)
- ▶ Bivariat als „Fächer“ im Plot erkennbar
- ▶ Inhaltlich oft Interaktion zwischen eingeschlossenen / ausgeschlossenen Variablen → Respezifikation des Modells

Was folgt aus Autokorrelation und Heteroskedastizität?

- ▶ OLS-Schätzungen sind unverzerrt
 - ▶ Heteroskedasizität: Größere Varianz von ϵ bei hohen Werten von x , aber Mittelwert immer noch null → an Linie ändert sich nichts
 - ▶ (zeitliche) Autokorrelation: Wenn positive ϵ auf positive und negative ϵ auf negative folgen, wird Linie nach oben oder unten gezogen, bleibt aber im Mittel wieder unverzerrt
- ▶ Aber: Die Streuung der Schätzwerte wird größer
- ▶ D. h. die normalen Formeln unterschätzen den realen Standardfehler
- ▶ Bei großen Stichproben ist Heteroskedasizität nur in extremen Fällen ein ernstes Problem

Was folgt aus Autokorrelation und Heteroskedastizität?

- ▶ Bei strukturierten Daten unterschätzt die Varianz der Residuen die Varianz von ϵ jedoch oft dramatisch
- ▶ Dadurch, daß Regressionslinie in Richtung der (autokorrelierten) ϵ verzerrt wird, ergeben sich relativ geringe Abweichungen
- ▶ Linie paßt „zu gut“
- ▶ Alternativ gewendet: Der effektive Stichprobenumfang ist sehr viel kleiner als der numerische Stichprobenumfang, weil die Fälle nicht wirklich unabhängig voneinander sind

Was tun?

- ▶ Im Standardmodell ist ϵ ein Vektor der Länge n , dessen Werte aus identischen Normalverteilungen mit dem Mittelwert null und der Varianz σ^2 stammen: $\epsilon \sim N(0, \sigma^2)$
- ▶ Flexibleres Modell: Diese Definition kann erweitert werden, indem man σ^2 durch eine Matrix ersetzt: $\epsilon \sim N(0, \Sigma_{\epsilon\epsilon})$

$$\Sigma_{\epsilon\epsilon} = \sigma^2 \begin{pmatrix} 1 & \rho_1 & \rho_2 & \cdots & \rho_{n-1} \\ \rho_1 & 1 & \rho_1 & \cdots & \rho_{n-2} \\ \rho_2 & \rho_1 & 1 & \cdots & \rho_{n-3} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \rho_{n-1} & \rho_{n-2} & \rho_{n-3} & \cdots & 1 \end{pmatrix}$$

Was tun?

- ▶ Die ρ stehen für die Korrelation der ϵ zwischen den Meßpunkten
- ▶ Wenn die Elemente der Diagonalen ungleich 1 sind:
Heteroskedastizität
- ▶ Problem: $\Sigma_{\epsilon\epsilon}$ hat zuviele Elemente, um sie aus den Daten zu schätzen
- ▶ Es wird ein einfacher Prozeß angenommen, z. B. daß alle ρ außer ρ_1 gleich null sind
- ▶ $\epsilon_t = \rho_1 \epsilon_{t-1} + \nu_t$
- ▶ Vielzahl spezieller Modelle
- ▶ Häufig sinnvoll: „Normal“ schätzen, Standardfehler korrigieren (PCSE, robuste VCE)

Warum soll ϵ normalverteilt sein?

- ▶ Nur notwendig, um in kleinen Stichproben Konfidenzintervalle / Signifikanztests berechnen zu können
- ▶ In großen Stichproben Verteilung der Schätzungen auch ohne Annahme 10 näherungsweise normal
- ▶ Normalverteilung oft ein sinnvolles Modell für die Verteilung von ϵ

Was ist das Fazit für heute?

- ▶ In der Regel verwenden wir OLS, um von einer Stichprobe auf Parameter einer Grundgesamtheit zu schließen
- ▶ Als Schätzverfahren hat OLS erfreuliche Eigenschaften. . .
- ▶ Sofern eine Reihe von zumindest intuitiv nachvollziehbaren Voraussetzungen erfüllt ist
- ▶ Ansonsten zwei Probleme
 - ▶ Verzerrte Schätzungen
 - ▶ Zu optimistische Standardfehler

Übung für heute

- ▶ Starten Sie STATA
- ▶ Geben Sie folgende Befehle ein:
- ▶ `webuse set „http://www.kai-arzheimer.com/Lehre-Regression/“` (verwenden Sie die einfachen Anführungszeichen über der 2)
- ▶ `webuse beispiel1`
- ▶ Mit `reg y x1 x2 prod` schätzen Sie eine lineare Regression von y auf x_1 , x_2 und einen Interaktionsterm
- ▶ mit `vce` erhalten Sie die Varianz-Kovarianz-Matrix
- ▶ Erläutern Sie in Ihren eigenen Worten die Bedeutung der Werte in dieser Matrix (einige Sätze genügen). Wie kommen Sie von dieser Matrix zu den von `reg . . .` ausgegebenen Standardfehlern?
- ▶ Schicken Sie die Antwort bis nächsten Mittwoch per Mail an mich (subject: Übung 2)