

Seminar „Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie“

Sommersemester 2012

Dieter Nautz, Gunda-Alexandra Detmers

Das Seminar „Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie“ richtet sich an Studierende in den Masterstudiengängen *Economics* und *Statistics* sowie an *Diplomstudierende* im Wahlfach Ökonometrie. Die Veranstaltung hat zum **Ziel**, dass die Teilnehmer eigenständig mit modernen Methoden der Zeitreihenökonometrie [VARs, Fehlerkorrekturmodelle, Einheitswurzel- und Ko-integrationsanalyse, (G)ARCH-Modelle] arbeiten und auf eine empirisch relevante Fragestellung aus den Gebieten der Makroökonomik, Geldpolitik oder Finance anwenden.

Als **Vorkenntnisse** werden für Master-Studierende der Besuch der Veranstaltung „Ökonometrische Analyse“ sowie für Diplomstudierende der Besuch der Veranstaltungen Ökonometrie I, Ökonometrie II sowie Zeitreihenanalyse vorausgesetzt. Außerdem sollten Sie bereits über eigene Erfahrung mit ökonometrischer Software z.B. **EViews**, **Stata**, **Gretl** verfügen.

Die **Vorbesprechung** zum Seminar findet am Freitag, den 13. April 2012 statt. Als **Zugangsvoraussetzung** zur Teilnahme am Seminar findet am 27. April 2012 eine Eingangsklausur statt, in welcher die in den Übungen vermittelten Methoden und deren empirische Anwendungen geprüft werden. Die **Abschlussnote** des Seminars setzt sich aus der schriftlichen Ausarbeitung der Seminararbeit (60%) sowie aus dem Vortrag und der Beteiligung am Seminar (40 %) zusammen. Das Seminar gilt als *nicht bestanden*, sobald eine der Leistungen als *nicht bestanden* bewertet wird.

Vorläufige Termine

Seminarvorbesprechung:	13. April 2012 , 14-15 Uhr (HS 328, Boltzmannstr. 20)
Übungen:	16. + 19. + 23. April 2012 (K005, Garystr. 21)
Eingangsklausur:	Freitag, den 27. April 2012: 14-15 Uhr (HS 328)
Themenpräferenz & verbindliche Anmeldung:	Mittwoch, den 2. Mai 2012 bis 12 Uhr (<i>per Email an gunda-alexandra-detmers[at]fu-berlin.de</i>)
Themenvergabe	bis 04. Mai 2012 per Email
Abgabe der Seminararbeit	bis 02. Juli 2012 um 10 Uhr
Vorträge	Anfang Juli als Blockveranstaltung

Literatur

Zur Vorbereitung auf das Seminar und die Übungen empfehlen wir Ihnen folgendes Buch:

- Kirchgässner, G./ Wolters, J. (2007): Introduction to Modern Time Series Analysis, Berlin: Springer

weitere Literaturhinweise:

- Lütkepohl, H./ Krätzig, M. (2004): Applied Time Series Econometrics, Cambridge: Cambridge University Press.
- Enders, W. (2010): Applied Econometric Time Series, Hoboken, NJ: Wiley.