

Ökonometrische Analyse

Wintersemester 2010/2011

Dieter Nautz, Gunda-Alexandra Detmers

1 Allgemeines

Das Modul 'Ökonometrische Analyse' ist eine 2+1 Veranstaltung, die sich aus einer Vorlesung und einer begleitenden Übung im 14-tg. Rhythmus zusammensetzt.

Die Veranstaltung richtet sich an Studenten im Masterstudiengang *Economics, Public Economics, und Finance, Accounting, Taxation and Supplements* sowie an *Diplomstudierende der VWL und BWL*. Letztere können sich den Kurs im Wahlfach Ökonometrie als Ökonometrie III anrechnen lassen.

Die erste Veranstaltung findet am 22.10.2010 von 8:30 bis 12:00 in Hs 102 (Garystraße 21) statt. Begleitend zu Vorlesung und Übung wird ein Blackboard-Kurs eingerichtet, in dem die Materialien zugänglich sind. Das Passwort wird in der ersten Veranstaltung bekanntgegeben.

Die Modulprüfung setzt sich aus einer Klausur (80%) am Ende des Semesters (voraussichtlich am 18.2.2011 innerhalb der Vorlesung) und der regelmäßigen Abgabe von Aufgaben (20%) während des Semesters zusammen.

Am 19.11.2010 findet keine Veranstaltung statt.

2 Literatur

Vorlesung und Übung orientieren sich an:

- Heij et al.(2004) "Econometric Methods with Applications in Business and Econometrics", *Oxford University Press*, New York.

Zur Vorbereitung empfehlen wir folgende Bücher, die typischerweise im Bachelor-Studium behandelt werden:

- Hill et al.(2008) "Principles of Econometrics", *John Wiley & Sons*.
- Stock, J.H. and Watson,M.W. (2007) "Introduction to Econometrics", *Pearson Education*.

Als deutsches Lehrbuch empfehlen wir z.B.:

- Hackl, P. (2005) "Einführung in die Ökonometrie", *Pearson Studium*, München.

3 Grundlagen

Das Modul setzt Kenntnisse der Statistik sowie der Matrix-Algebra voraus. Auf der 'Aktuelles'-Seite des Instituts finden Sie Dateien zur Wiederholung dieser Grundlagen.

Im Rahmen der Übung wird die bereits im Bachelor-Studiengang eingeführte Ökonometrie-Software EViews verwendet. Die aktuelle Version dieser Software ist in den PC-Pools installiert und kann auch auf Ihrem privaten PC über VPN-Zugang verwendet werden. Weitere Informationen zur Nutzung von EViews finden Sie im Blackboard-Kurs. Dort finden Sie auch eine Datei, die anhand eines Beispiels in EViews einführt.

Sollte große Nachfrage für eine Einführung in EViews bestehen, so wird am Anfang des Semesters (voraussichtlich in der dritten Vorlesungswoche) eine Einführung im PC-Pool stattfinden. Weitere Informationen folgen in der Übung.

4 Gliederung

1. Introduction
2. Multiple Regression
3. Non-linear Methods
4. Diagnostic Tests and Model Adjustments
5. Time Series and Dynamic Models