

Seminar Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie, WS 09/10

Kontakt:

Prof. Dr. Dieter Nautz: dieter.nautz[at]fu-berlin.de

Sascha Becker: sascha.becker[at]fu-berlin.de

Anrechenbare Schwerpunkte:

Master-Studiengang VWL Economics und Diplom (Wahlgebiet Ökonometrie)

Ziel des Seminars:

Eigenständiges Arbeiten mit modernen Methoden der Zeitreihenökonometrie (VARs, Fehlerkorrekturmodelle, Einheitswurzel- und Kointegrationsanalyse, (G)ARCH-Modelle) und deren Anwendung auf eine empirisch relevante Fragestellung aus den Gebieten der Makroökonomik, Geldpolitik (Finance).

Vorkenntnisse:

- Master: Ökonometrische Analyse
- Diplom: Ökonometrie I, Ökonometrie II, Zeitreihenanalyse
- Ökonometrische Software: z.B. Eviews, Stata, Gretl

Vorläufige Termine:

Seminarvorbesprechung :	14.10.2009, 15-16 Uhr (HS 108)
3 Übungen:	19.10, 26.10 und 02.11. jeweils 16-18 Uhr (PC-Pool 1)
<i>Verbindliche</i> Anmeldung:	bis 04.11, 12 Uhr (per Mail an sascha.becker[at]fu-berlin.de)
Eingangsklausur:	06.11, 14-15 Uhr
Themenvergabe:	noch offen
Abgabe der Seminararbeit:	bis 11.01.2010, 12 Uhr
Präsentationen:	vorauss. Ende Januar

Bewertungsschüssel:

20% Eingangsklausur

30% Vortrag+Diskussion

50% Schriftliche Ausarbeitung der Seminararbeit

Das Seminar gilt als Nichtbestanden, sobald eine der drei obigen Leistungen als Nichtbestanden bewertet wird.

Informationen zur Eingangsklausur

In den Übungen werden die empirischen Anwendungen relevanter Methoden (z.B. Johansen-Kointegrationstests, VARs etc) im PC-Pool mit **Eviews** durchgeführt. Der hier vermittelte Stoff wird in der Eingangsklausur geprüft.

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

Kirchgässner, G./ Wolters, J. (2006): Einführung in die moderne Zeitreihenanalyse, München: Vahlen

Weitere Literaturhinweise

Lütkepohl, H./ Kräzig, M. (2004): Applied Time Series Econometrics, Cambridge: Cambridge University Press.

Enders, W. (1994): Applied Econometric Time Series, New York: John Wiley.

Favero, C. (2001): Applied Macroeconometrics, Oxford: Oxford University Press.