

Angewandte Zeitreihenökonomie

Voraussetzungen

Einführung in die Ökonometrie, Einführung in die Zeitreihenanalyse, Mathe, Statistik

Form

Vorlesung / Proseminar (6 Leistungspunkte)

Struktur der Veranstaltung

1. *Bis Mitte Mai Vorlesung und Übung*
voraussichtlich Dienstag, 10 – 12 Uhr und 12 – 14 Uhr
 - Vorlesung
 - Besprechung der Übungsaufgaben
 - Vertiefung des Vorlesungsstoffs anhand empirischer Beispiele und simulierter Daten
 - Im Anschluss Eingangsklausur, nicht relevant für Endnote, aber Indikatorfunktion
2. *Empirische Hausarbeit und Präsentation*
 - Vorstellung der Themen direkt im Anschluss an die Klausur (Mitte Mai)
 - Empirische Hausarbeit (ca. 12 Seiten) und kurze Präsentation gehen beide in die Endnote ein
 - Abgabe der Arbeit eine Woche vor der Präsentation
 - Präsentation der Arbeit (ca. 15 min) in Blockveranstaltung am Ende des Semesters
 - 2er-Teams bevorzugt

Inhalt der Vorlesung und Übung

- Themen der ‚Einführung in die Zeitreihenanalyse‘
- ADL Modelle
- Granger Kausalität
- Spurious Regression
- Kointegration

Literatur

- Kirchgässner / Wolters / Hassler
‘Introduction to Modern Time Series Analysis’
- Enders
‘Applied Econometric Time Series’

Unterlagen

Materialien werden im Blackboard zur Verfügung gestellt.
EViews im PC Pool und über VPN client verfügbar.