

Lehrveranstaltung

## **Univariate Zeitreihenanalyse**

*Vorlesung und Übung (2+1 SWS), 6 ECTS Punkte*

### **Studienabschnitte:**

Master Economics: Schwerpunktbereich „Quantitative Analyse“  
Master Statistics: Vertiefungsgebiet „Ökonometrie“

### **Zeit und Ort:**

Vorlesung: Di, 10 – 12 Uhr (*c.t.*), Hs 106 (wöchentlich, ab 14.4.2015)  
Übung: Di, 14 – 16 Uhr (*c.t.*), HS 104a (14tägig, ab 21.4.2015)

### **Sprache:**

Englisch

### **Voraussetzungen:**

„Ökonometrische Analyse“ (oder äquivalenter Masterkurs in Ökonometrie)

### **Modulprüfung:**

Abschlussklausur über 120 Minuten am Ende des Semesters

### **Inhalt:**

1. Einführung und Konzepte
2. Autoregressive Moving-Average Modelle
3. Nichtstationäre Zeitreihen
4. Modellierung von Volatilität
5. Vektorautoregressive Modelle

### **Literatur:**

Kirchgässner, G., Wolters, J. und Hassler, U.: *Introduction to Modern Time Series Analysis*, 2. Auflage, Springer, 2013.

Heij, C., de Boer, P., Franses, P.H., Kloek, T. und van Dijk, H.K.: *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*, Oxford University Press, 2004.

Hamilton, J.D.: *Time Series Analysis*, Princeton University Press, 1994.

Hayashi, F.: *Econometrics*, Princeton University Press, 2000.

### **Weitere Informationen:**

Alle Materialien, Ankündigungen, Zeitplanänderungen etc. werden über *Blackboard* (<https://lms.fu-berlin.de>, Kursname: Univariate Zeitreihenanalyse, Kurs-ID: WIWISS V 104100 15S) verfügbar gemacht.