

Lehrveranstaltung

## **Univariate Zeitreihenanalyse**

*Vorlesung und Übung (2+1 SWS)*

### **Studienabschnitt:**

Master Economics: Schwerpunktbereich „Quantitative Analyse“ (6 Leistungspunkte)

Master Statistics: Vertiefungsgebiet „Ökonometrie“ (5 Studienpunkte)

Diplom VWL: Wahlfach „Ökonometrie“ (WPV „Spektralanalyse“, 3 Bonuspunkte)

### **Zeit und Ort:**

Vorlesung: Do, 12 – 14 Uhr (*c.t.*), HS K005

Übung: Fr, 10 – 12 Uhr (*c.t.*), HS 107 (14tägig, ab 25.10.2013)

Die erste Veranstaltung findet am Donnerstag, den 17. Oktober 2013 statt.

### **Voraussetzungen:**

„Ökonometrische Analyse“

### **Modulprüfung:**

Abschlussklausur über 120 Minuten am Ende des Semesters

### **Inhalt:**

1. Stationäre Zeitreihen
2. Nichtstationäre Zeitreihen
3. Schätzen und Testen
4. Prognosen

### **Literatur:**

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.

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

Enders, W.: *Applied Econometric Time Series*, 3. Auflage, Wiley & Sons, 2010.

### **Weitere Informationen:**

Zu dieser Veranstaltung wird ein Kurs im Blackboard (WIWISS V 104100 13W) eingerichtet. Das ggf. benötigte Passwort wird in der ersten Veranstaltung bekannt gegeben.