

Bachelor VWL

Einführung in die Zeitreihenanalyse

Wahlveranstaltung im Vertiefungsgebiet „Quantitative Methoden“

Form:

Vorlesung und Übung (2+2 SWS) für 6 Leistungspunkte.

Die Veranstaltung ist auch im Vertiefungsgebiet Ökonometrie des Bachelorstudiengangs BWL sowie als Wahlpflichtveranstaltung „Zeitreihenanalyse“ (4 Bonuspunkte) im Wahlfach Ökonometrie des Diplom-Studiengangs VWL anrechenbar.

Zeit und Ort:

Vorlesung: Mi, 12 – 14 Uhr (*c.t.*), HS 104

Übung: Do, 14 – 16 Uhr (*c.t.*), HS 105

Die erste Veranstaltung findet am 17. Oktober 2012 statt.

Voraussetzungen:

„Einführung in die Ökonometrie“

Modulprüfung:

Abschlussklausur über 120 Minuten am Ende des Semesters

Inhalt:

1. Autoregressive Modelle
2. Moving Average und ARMA Modelle
3. Modellierung von Volatilität
4. Modelle mit exogenen Regressoren
5. Vektorautoregressive Modelle

Literatur:

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

Kirchgässner, G. und J. Wolters: *Introduction to Modern Time Series Analysis*, Springer-Verlag, 2008.

Weitere Informationen:

Zu dieser Veranstaltung wird ein Kurs im Blackboard (WIWISS V 102070 12W) eingerichtet. Das ggf. benötigte Passwort wird in der ersten Veranstaltung bekannt gegeben.