

Bachelor VWL

Zeitreihenökometrie

Wahlveranstaltung im Vertiefungsgebiet „Quantitative Methoden“

Form:

Vorlesung und Übung (2+2 SWS) für 6 Leistungspunkte. Die Veranstaltung ist auch im Wahlfach Ökonometrie des Diplom-Studiengangs VWL als Wahlpflichtveranstaltung „**Ökonometrie II**“ (4 Bonuspunkte) anrechenbar.

Zeit und Ort:

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

Übung: Mi, 16 – 18 Uhr (*c.t.*), HS 107

Die erste Veranstaltung findet am 18. April 2012 statt.

Beschreibung:

Die Teilnehmer sollen in die Lage versetzt werden, ökonomische Verhaltensgleichungen auf der Basis von Zeitreihendaten zu beurteilen, aber solche Gleichungen auch zu spezifizieren, zu schätzen und zu testen. Als Modellierungsgrundlage dienen autoregressive Modelle mit verteilten Verzögerungen bezüglich der erklärenden Variablen und deren alternative Darstellungen in Form von distributed lag-Modellen und Fehlerkorrekturmodellen. Ein für die praktische Anwendung wichtiger Aspekt ist die Analyse nichtstationärer Zeitreihen mittels Einheitswurzeltests und Kointegration.

Voraussetzungen:

Einführung in die Ökonometrie

Modulprüfung:

Abschlussklausur über 120 Minuten zum Ende des Semesters, voraussichtlich am 18. Juli 2012, 12 – 14 Uhr (*s.t.*).

Gliederung:

1. Stationäre univariate Modelle
2. Nichtstationäre univariate Modelle
3. Einzelgleichungsmodelle mit exogenen Regressoren
4. Mehrgleichungsmodelle

Literatur:

Enders, Walter: *Applied Econometric Time Series*, 3rd Edition, John Wiley & Sons, 2010.

Kirchgässner, G. und J. Wolters: *Einführung in die moderne Zeitreihenanalyse*, Verlag Vahlen, 2006.