

Seminar „Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie“

Wintersemester 2015

Dieter Nautz, Till Strohsal, Lars Winkelmann

Das Seminar „Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie“ richtet sich an Studierende in den Masterstudiengängen *Economics* und *Statistics*. Die Veranstaltung hat zum **Ziel**, dass die Teilnehmer eigenständig mit modernen Methoden der Zeitreihenökonometrie (VARs, Fehlerkorrekturmodelle, Einheitswurzel- und Kointegrationsanalyse, (G)ARCH-Modelle) arbeiten und auf eine empirisch relevante Fragestellung aus den Gebieten der Makroökonomik, Geldpolitik oder Finance anwenden.

Als **Vorkenntnisse** wird für Master-Studierende der Besuch der Veranstaltung Univariate Zeitreihenanalyse vorausgesetzt. Außerdem sollten Sie bereits über eigene Erfahrung mit ökonometrischer Software z.B. *EViews*, *Stata*, *Gretl* verfügen.

Die erste *Vorlesung* findet am Mittwoch, den 14. Oktober 2015 statt. Die **Abschlussnote** des Seminars setzt sich aus der schriftlichen Ausarbeitung der Seminararbeit sowie aus dem Vortrag und der Beteiligung am Seminar zusammen. Das Seminar gilt als *nicht bestanden*, sobald eine der Leistungen als *nicht bestanden* bewertet wird.

Vorläufige Termine

Vorbesprechung:	Di., 14. Juli 2015, 15:45 Uhr	HS 104a
Vorlesungen:	Mi. 14. + 21. + 28. Okt 2015, 14-16 Uhr	HS 104a
Übungen:	Fr., 16. + 23. + 30. Okt 2015, 10-14 Uhr	HS PC Pool 1
verbindliche Anmeldung & Themenvergabe:	Mi., den 4. Nov 2015: 14-16 Uhr	HS 328
Abgabe der Seminararbeit	bis Fr., den 29. Jan 2016 um 11:30 Uhr	
Vorträge	Fr., 05. Feb 2016 ab 9 Uhr als Blockveranstaltung	Kaminzimmer

Kursunterlagen

- Blackboard unter *Akt. Forschungsfragen d. Ökonom. (S1)*

Literatur

Zur Vorbereitung auf das Seminar und die Übungen empfehlen wir Ihnen folgende Bücher:

- Kapitel 7 aus: Heij, C. / P. de Boer / P.H. Franses / T. Kloek / H.K. van Dijk: *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*, Oxford University Press, 2004.
- Kirchgässner, G./ J. Wolters / U. Hassler (2012): *Introduction to Modern Time Series Analysis*, Berlin: Springer

weitere Literaturhinweise:

- Lütkepohl, H./ Krätzig, M. (2004): *Applied Time Series Econometrics*, Cambridge: Cambridge University Press.
- Enders, W. (2010): *Applied Econometric Time Series*, Hoboken, NJ: Wiley.