

Vertiefungsgebiet Quantitative Methoden

Modul: Zeitreihenökometrie

Qualifikationsziele: Die Studierenden 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.

Inhalte: Verallgemeinerte Methode der Kleinsten Quadrate, Modelle mit verteilten Verzögerungen, autoregressive verteilte lag-Modelle, Stationarität versus Nichtstationarität, Kointegration und Fehlerkorrekturmodelle, Schätzen und Testen bei Kointegration.

Die vorangehende Absolvierung des Moduls „Einführung in die Ökonometrie“ wird empfohlen.

Lehr- und Lernformen	Präsenzstudium (Semesterwochenstunden = SWS)	Arbeitsaufwand (Stunden)	Formen aktiver Teilnahme
Vorlesung	2	Präsenzzeit Vorlesung (30) Präsenzzeit Übung (30)	Beantwortung von Diskussionsfragen, Stellungnahme zu Thesen
Übung	2	Vor- und Nachbereitung des Stoffs (60) Prüfungsvorbereitung und -bearbeitung (60)	Behandlung von Problemstellungen und Aufgaben

Veranstaltungssprache: Deutsch

Arbeitszeitaufwand/h insgesamt: 180

Dauer des Moduls: ein Semester

Häufigkeit des Angebots: jedes zweite Semester

Vertiefungsgebiet Quantitative Methoden

Modul: Zeitreihenökometrie		
Zugangsvoraussetzungen: Keine		
Lehr- und Lernformen	Modulprüfung	Pflicht zu regelmäßiger Teilnahme
Vorlesung	Klausur oder Multiple-Choice-Test (Bearbeitungsdauer: 120 Minuten). An die Stelle einer Klausur bzw. eines Multiple-Choice-Tests können mehrere Tests mit gleicher Gesamtbearbeitungsdauer treten.	Teilnahme wird empfohlen
Übung		Teilnahme wird empfohlen
Leistungspunkte: 6		

Modul: Einführung in die Zeitreihenanalyse		
Zugangsvoraussetzungen: Keine		
Lehr- und Lernformen	Modulprüfung	Pflicht zu regelmäßiger Teilnahme
Vorlesung	Klausur oder Multiple-Choice-Test (Bearbeitungsdauer: 120 Minuten). An die Stelle einer Klausur bzw. eines Multiple-Choice-Tests können mehrere Tests mit gleicher Gesamtbearbeitungsdauer treten.	Teilnahme wird empfohlen
Übung		Teilnahme wird empfohlen
Leistungspunkte: 6		