

Seminar „Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie“

Wintersemester 2015

Dieter Nautz, 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.

Ein Teil der zu erbringenden Leistung besteht darin, sich in eine Methode der modernen Zeitreihenanalyse einzuarbeiten. Als Grundlage jeder Arbeit dient ein empirisches Referenzpapier und Referenzen für ökonometrische Methoden.

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*, *R* verfügen.

Ablauf und vorläufige Termine

Vorbesprechung:	Mi., 14. Okt 2015, 14:15 Uhr <i>Vorstellung der Themen (siehe "Themenliste", eigene Themen möglich).</i>	HS 104a
verbindliche Anmeldung:	bis Mi., den 21. Okt 2015 per Mail.	
Vorträge I	51. KW als Blockveranstaltung <i>Präsentation der ökonomischen Fragestellung und ökonometrischen Methode. Ausblick auf empirische Studie.</i>	tba
Vorträge II	6. KW 2016 als Blockveranstaltung <i>Präsentation der Seminararbeit inklusive empirischer Ergebnisse.</i>	tba
Abgabe der Seminararbeit	bis Mo., den 21. März 2016.	R330 Boltzm. 20

- Die Prüfungsleistung besteht aus zwei Vorträgen und der Abgabe einer Seminararbeit.
- Arbeit in Zweiergruppen ist erwünscht.
- Die Vortragszeit beträgt jeweils 15 Minuten + Diskussion. Die schriftliche Arbeit umfasst nicht mehr als 15 Seiten (exklusive Anhang). Je Arbeitsgruppe wird *eine* Arbeit abgegeben.
- Betreuung findet in den wöchentlichen Sprechstunden statt.
- Die Themenliste ist auf Blackboard verfügbar (Kurs WIWISS_V_104116_15W).