

## Ökonometrische Analyse

Pflichtveranstaltung im Kernbereich des Masterstudiengangs *Economics*

### **Form**

Vorlesung und Übung (2+1 SWS) für 5 Leistungspunkte. Die Veranstaltung richtet sich auch an Studierende der Masterstudiengänge *Public Economics* und *Finance, Accounting, Taxation and Supplements* sowie an Diplomstudierende mit Wahlfach Ökonometrie (als Wahlpflichtveranstaltung „*Ökonometrie III*“ für 4 Bonuspunkte).

### **Zeit und Ort**

Vorlesung: Fr., 8.30 – 10 Uhr, HS 104a

Übung (14-tägig, englisch): Fr., 10 – 12 Uhr *c.t.* / Mo., 8.30 – 10 Uhr, HS 104a

Die erste Vorlesung findet am 21.10., die erste Übung am 28.10. / 31.10.2011 statt.

### **Modulprüfung**

Zusammengesetzte Prüfung bestehend aus einer Abschlussklausur (80%), voraussichtlich am 17.02.2012, 8 – 10 Uhr *s.t.*, und übungsbegleitend abzugebenden Hausaufgaben (20%).

### **Inhalt**

- Multiple Regression
- Nichtlineare Methoden
- Diagnostische Tests und Modellanpassungen
- Zeitreihen und Dynamische Modelle

### **Literatur**

Vorlesung und Übung orientieren sich an

- Heij, C., P. de Boer, P.H. Franses, T. Kloek und H.K. van Dijk: *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*, Oxford University Press, 2004.

### **Vorbereitung**

Wir empfehlen den Besuch des Vorkurses „Quantitative Methoden“ bei Frau Gunda-Alexandra Detmers vom 11. bis 14. Oktober 2011. Weitere Informationen hierzu erhalten Sie auf den Webseiten der Masterstudiengänge *Economics* und *Public Economics* und des Instituts für Statistik und Ökonometrie.

Empfehlenswerte vorbereitende Literatur umfasst z.B.

- Hill, R.C., W.E. Griffiths und M.A. Lim: *Principles of Econometrics*, John Wiley & Sons, 2011,
- Stock, J. und M. Watson: *Introduction to Econometrics*, Addison-Wesley, 2011,

oder die deutschsprachigen Lehrbücher

- Hackl, P.: *Einführung in die Ökonometrie*, Pearson Studium, 2005,
- von Auer, L.: *Ökonometrie: Eine Einführung*, Springer, 2011.