

Ökonometrische Analyse

Pflichtveranstaltung im Kernbereich des Masterstudiengangs *Economics*

Form

Vorlesung und Übung (2+1 SWS) für 6 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., 10 – 12 Uhr, HS 105

Übung, 14-tägig: Fr., 9:30 – 10 Uhr HS 105

Die erste Vorlesung findet am 17.10. (8.30 – 12, ausnahmsweise 4 Std. VL), die erste Übung am 24.10.2014 statt.

Modulprüfung

Abschlussklausur über 120 Minuten.

Inhalt

- Regressionsanalyse
- 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 Herrn Till Strohsal vom 06. bis 10. Oktober 2014. Weitere Informationen hierzu erhalten Sie auf den Webseiten der Masterstudiengänge *Economics* und *Public Economics*.

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.