

Lehrveranstaltung

Einführung in die Zeitreihenanalyse

Vorlesung und Übung (2+2 SWS)

Studienabschnitt:

Bachelor VWL: Vertiefungsgebiet „Quantitative Methoden“ (5. Sem., 6 Leistungspunkte)

Bachelor BWL: Vertiefungsgebiet „Ökonometrie“ (5. Sem., 6 Leistungspunkte)

Diplom VWL: Wahlfach „Ökonometrie“ (WPV „Zeitreihenanalyse“, 4 Bonuspunkte)

Zeit und Ort:

Vorlesung: Do, 10 – 12 Uhr (*c.t.*), HS 101

Übung: Mi, 8 – 10 Uhr (*c.t.*), HS 106 (ab 23.10.2013)

Vorausgesetzte Kenntnisse:

Einführung in die Ökonometrie

Modulprüfung:

Abschlussklausur über 120 Minuten am Ende des Semesters

Inhalt:

1. Modelle mit exogenen Regressoren / Distributed-Lag-Modelle
2. Autoregressive und ARMA-Modelle
3. Nichtstationarität
4. Kointegration

Literatur:

Hill, R.C., W.E. Griffiths und G.C. Lim: *Principles of Econometrics*, 4. Auflage, Wiley & Sons, 2011.

Kirchgässner, G., J. Wolters und U. Hassler: *Introduction to Modern Time Series Analysis*, 2. Auflage, Springer-Verlag, 2013,

auch ähnlich in deutscher Ausgabe erhältlich:

Kirchgässner, G. und J. Wolters: *Einführung in die Moderne Zeitreihenanalyse*, Verlag Vahlen, 2006.

Enders, W.: *Applied Econometric Time Series*, 3. Auflage, Wiley & Sons, 2010.

Weitere Informationen:

Vorlesungsunterlagen und weiteres Kursmaterial sind über Blackboard (<http://lms.fu-berlin.de>, Kurs WIWISS V 102070 13W) verfügbar. Das ggf. benötigte Passwort wird in der ersten Veranstaltung bekannt gegeben.