

Bachelor VWL

Zeitreihenökonomie

Wahlveranstaltung im Vertiefungsgebiet „Quantitative Methoden“

Form:

Vorlesung und Übung (2+2 SWS) für 6 Leistungspunkte. Die Veranstaltung ist auch im Wahlfach Ökonometrie des Diplom-Studiengangs als Wahlpflichtveranstaltung „**Ökonometrie II**“ (4 Bonuspunkte) anrechenbar.

Zeit und Ort:

Di, 10 – 12 Uhr (*c.t.*), HS K 005

Do, 10 – 12 Uhr (*c.t.*), HS K 005

Die erste Veranstaltung findet am 19.10.2010 statt.

Beschreibung:

Die Teilnehmer 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.

Voraussetzungen: „Einführung in die Ökonometrie“ (dringend empfohlen), „Einführung in die Zeitreihenanalyse“ (wäre hilfreich).

Modulprüfung: Abschlussklausur über 120 Minuten zum Ende des Semesters.

Inhalt:

- I. Stationäre univariate Modelle
- II. Nichtstationäre univariate Modelle
- III. Einzelgleichungsmodelle mit exogenen Regressoren
- IV. Mehrgleichungsmodelle

Literatur:

Enders, Walter: *Applied Econometric Time Series*, 3rd Edition, John Wiley & Sons, 2010.

Kirchgässner, G. und Wolters, Jürgen: *Einführung in die moderne Zeitreihenanalyse*, Verlag Vahlen, 2006.