

# Seminar Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie, WS 09/10

## Kontakt:

Prof. Dr. Dieter Nautz: dieter.nautz[at]fu-berlin.de

Sascha Becker: sascha.becker[at]fu-berlin.de

## Anrechenbare Schwerpunkte:

Master-Studiengang VWL Economics und Diplom (Wahlgebiet Ökonometrie)

## Ziel des Seminars:

Eigenständiges Arbeiten mit modernen Methoden der Zeitreihenökonometrie (VARs, Fehlerkorrekturmodelle, Einheitswurzel- und Kointegrationsanalyse, (G)ARCH-Modelle) und deren Anwendung auf eine empirisch relevante Fragestellung aus den Gebieten der Makroökonomik, Geldpolitik (Finance).

## Vorkenntnisse:

- Master: Ökonometrische Analyse
- Diplom: Ökonometrie I, Ökonometrie II, Zeitreihenanalyse
- Ökonometrische Software: z.B. Eviews, Stata, Gretl

## Vorläufige Termine:

Seminarvorbesprechung :	14.10.2009, 15-16 Uhr (HS 108)
3 Übungen:	19.10, 26.10 und 02.11. jeweils 16-18 Uhr (PC-Pool 1)
<i>Verbindliche</i> Anmeldung:	bis 04.11, 12 Uhr (per Mail an sascha.becker[at]fu-berlin.de)
Eingangsklausur:	06.11, 14-15 Uhr
Themenvergabe:	noch offen
Abgabe der Seminararbeit:	bis 11.01.2010, 12 Uhr
Präsentationen:	vorauss. Ende Januar

### **Bewertungsschüssel:**

20% Eingangsklausur

30% Vortrag+Diskussion

50% Schriftliche Ausarbeitung der Seminararbeit

Das Seminar gilt als Nichtbestanden, sobald eine der drei obigen Leistungen als Nichtbestanden bewertet wird.

### **Informationen zur Eingangsklausur**

In den Übungen werden die empirischen Anwendungen relevanter Methoden (z.B. Johansen-Kointegrationstests, VARs etc) im PC-Pool mit **Eviews** durchgeführt. Der hier vermittelte Stoff wird in der Eingangsklausur geprüft.

**Zur Vorbereitung** auf das Seminar und die Übungen empfehlen wir Ihnen folgendes Buch:

*Kirchgässner, G./ Wolters, J. (2006): Einführung in die moderne Zeitreihenanalyse, München: Vahlen*

### **Weitere Literaturhinweise**

Lütkepohl, H./ Kräzig, M. (2004): Applied Time Series Econometrics, Cambridge: Cambridge University Press.

Enders, W. (1994): Applied Econometric Time Series, New York: John Wiley.

Favero, C. (2001): Applied Macroeconometrics, Oxford: Oxford University Press.