

## Seminar „Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie“

Sommersemester 2013

Dieter Nautz, Till Strohsal

---

Das Seminar „Aktuelle Forschungsfragen der Ökonometrie“ richtet sich an Studierende in den Masterstudiengängen *Economics* und *Statistics* sowie an *Diplomstudierende* im Wahlfach Ökonometrie. Die Veranstaltung hat zum **Ziel**, dass die Teilnehmer eigenständig mit modernen Methoden der Zeitreihenökonometrie [VARs, Fehlerkorrekturmodelle, Einheitswurzel- und Ko-integrationsanalyse, (G)ARCH-Modelle] arbeiten und auf eine empirisch relevante Fragestellung aus den Gebieten der Makroökonomik, Geldpolitik oder Finance anwenden.

Als **Vorkenntnisse** werden für Master-Studierende der Besuch der Veranstaltung „Ökonometrische Analyse“ sowie für Diplomstudierende der Besuch der Veranstaltungen Ökonometrie I, Ökonometrie II sowie Zeitreihenanalyse vorausgesetzt. Außerdem sollten Sie bereits über eigene Erfahrung mit ökonometrischer Software z.B. **EViews**, **Stata**, **Gretl** verfügen.

Die **Vorbesprechung** zum Seminar sowie die erste Vorlesung finden am Dienstag, den 9. April 2013 statt. Als **Zugangsvoraussetzung** zur Teilnahme am Seminar findet am 29. April 2013 eine Eingangsklausur statt, in welcher die in den vorhergehenden Veranstaltungen vermittelten Methoden und deren empirische Anwendungen geprüft werden. Die **Abschlussnote** des Seminars setzt sich aus der schriftlichen Ausarbeitung der Seminararbeit sowie aus dem Vortrag und der Beteiligung am Seminar zusammen. Das Seminar gilt als *nicht bestanden*, sobald eine der Leistungen als *nicht bestanden* bewertet wird.

### Vorläufige Termine

Vorbesprechung / erste VL:	Di., <b>09. April 2013</b> , 16-19 Uhr	HS 104a
weitere VL:	Di. 16. + 23. April 2013, 16-19 Uhr	HS 104a
Übungen:	Fr., 12. + 19. + 26. April 2013, 14-17 Uhr	PC Pool 1
Eingangsklausur:	Mo., den <b>29. April 2013</b> : 17-18 Uhr	HS 328
verbindliche Anmeldung & Themenvergabe:	Fr., den 3. Mai 2013: 14-15 Uhr	HS 328
Abgabe der Seminararbeit	bis Fr., den 28. Juni 2013 um 11:30 Uhr	
Vorträge	Do., 4. Juli 2013 ab 9 Uhr als Blockveranstaltung	Kaminz.

### Kursunterlagen

- Blackboard unter *Akt. Forschungsfragen d. Ökonom. (S1)* oder ID: WIWISS\_V\_104116\_13S

### Literatur

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

- Kirchgässner, G./ Wolters, J. / Hassler, U. (2012): *Introduction to Modern Time Series Analysis*, Berlin: Springer

weitere Literaturhinweise:

- Lütkepohl, H./ Krätzig, M. (2004): *Applied Time Series Econometrics*, Cambridge: Cambridge University Press.
- Enders, W. (2010): *Applied Econometric Time Series*, Hoboken, NJ: Wiley.