RUPRECHT-KARLS-UNIVERSITÄT HEIDELBERG
ALFRED-WEBER-INSTITUT FÜR
WIRTSCHAFTSWISSENSCHAFTEN
Lehrstuhl für Empirische Wirtschaftsforschung
Prof. Dr. Christian Conrad

Sommersemester 2016

Makroökonometrie / Macroeconometrics

Vorlesung	Mi	09:15	10:45	AWI 02.036, Bergheimer Str. 58
Übung bzw. EViews Übung	Mo	14:00	16:00	AWI 02.036, Bergheimer Str. 58 bzw. PC-Pool I, Bergheimer Str. 58

Beginn: Vorlesung am Montag, 18. April 2016 14:00 Uhr.
Die Veranstaltung am Mittwoch, 20. April 2016 entfällt.

Voraussetzungen:

Die Veranstaltung kann als wirtschaftswissenschaftliches Wahlmodul im Bachelor-Studiengang Economics (Politische Ökonomik) oder für die Vertiefungsfächer *Ökonometrie* sowie *Theoretische Statistik* im Diplom-VWL Studiengang belegt werden.

Kommentar:

Die Vorlesung vermittelt grundlegende Kenntnisse zur uni- und multivariaten Modellierung und Prognose von makroökonomischen Zeitreihen. Der Schwerpunkt der Veranstaltung wird auf der eigenständigen empirischen Anwendung der einzelnen Methoden durch die Kursteilnehmer liegen. Hierfür werden die Inhalte der Vorlesung durch methodische und empirische Übungen mit der Ökonometrie-Software EViews begleitet.

The lecture provides an introduction to the modern econometric techniques used in the analysis of macroeconomic time series. The lecture will be accompanied by methodological and empirical exercise sessions.

• Bergheimer Strasse 58 , 69115 Heidelberg • Telefon: (+49) 06221/54-2908
• http://www.uni-heidelberg.de/fakultaeten/wiso/awi/professuren/empwirtfor

Inhalt:

1. Makroökonomische Zeitreihen
2. Umfrage-Daten: Survey of Professional Forecasters (FED und EZB)
3. Modellierung von Trend, Saisonalität und Zyklus
4. Dynamische Regressionsmodelle
5. Vektor-Autoregressive Modelle
6. Stochastische Trends und Kointegration
7. Volatilität

1. Macroeconomic Time Series
2. Survey Data
3. Trend-Cycle Decompositions
4. Dynamic Regression Models
5. Vector-Autoregressions
6. Stochastic Trends and Cointegration
7. Volatility

Kurssprache: Deutsch

Leistungsnachweis: 90-minütige Klausur

Literatur:

Diebold, F. X. (2007). *Elements of Forecasting.* Thomson South-Western.
Enders, W. (1995). *Applied Econometric Time Series.* Wiley.
Stock, J. H. und M. W. Watson (2011). *Introduction to Econometrics*, Pearson International Edition.
Tsay, R. S. (2005). *Analysis of Financial Time Series.* Wiley.