

t.OEKM1 - Ökonometrie 1

Kursverantwortung: Marc Wildi, wlmr
Credits: 4
Schuljahr: 2009/2010
Zuletzt gespeichert: 18.08.2010 10:59

Lernziel:

Wichtige ökonomische Phänomene wie beispielsweise die Arbeitslosigkeit, die Inflation (Teuerung), das allgemeine Wirtschaftswachstum (Bruttoinlanprodukt) oder Finanzmarktrelevante Phänomene wie Aktienkurse, Zinsen oder Wechselkurse beispielsweise werden in regelmässigen mehr oder weniger kurzfristigen Zeitabständen gemessen.

Die entsprechenden Datensätze liefern ein Abbild der Dynamik der interessierenden Grössen im Zeitablauf. Von zentraler Bedeutung sind dabei Fragen über die zukünftige Entwicklung der Reihen (Prognose) und über das 'Risiko', das mit der Unsicherheit der Prognose verbunden ist. Im Modul Ökonometrie I werden zur Beantwortung dieser Fragen Verfahren aus der Zeitreihenanalyse eingeführt, deren Einsatzmöglichkeiten und Nutzen anhand vieler praktischer Beispiele illustriert werden. Besucher dieses Moduls erwerben die Fähigkeit, anhand geeigneter statistischer Instrumente Dynamiken in Zeitreihen zu unterscheiden, zu identifizieren und geeignet in die Zukunft zu extrapolieren.

Lerninhalt:

- Der Begriff der Zeitreihe
- Einfache Glättungsverfahren
- Stationäre Prozesse: MA-, AR- und ARMA-Prozesse
- Nicht-stationäre Prozesse: ARIMA-Prozesse
- Prognosefunktionen
- Filter

Vorkenntnisse:

WST1-2

Durchführung:

Unterrichtsart	Anzahl Lektionen pro Woche
Vorlesung	14x(2L+2L)
Übung/Praktika	
Gruppenunterricht	
Blockunterricht	
Seminar	

Leistungsnachweise:

Laut Tabelle oder gemäss schriftlicher Festlegung des Dozierenden zu Semesterbeginn!

Anzahl	Art	Gewichtung
1	Modulendprüfung	3
1	Prüfungen während Unterrichtszeit	1
	Weitere Leistungsnachweise	

Unterrichtssprache:

Deutsch

Unterrichtsunterlagen:

Skriptum, Übungsanleitung, Scriptfiles

W. Stier, 2001. Methoden der Zeitreihenanalyse. Springer Verlag.

Bemerkungen:

-