

t.OEKM2 - Ökonometrie 2

Kursverantwortung: Marc Wildi, wlmr
Credits: 6
Schuljahr: 2009/2010
Zuletzt gespeichert: 18.08.2010 11:03

Lernziel:

Die Ökonometrie befasst sich mit der quantitativen Analyse ökonomischer Phänomene. Viele traditionelle und (ansonsten) bewährte statistische Analysetools wie z.B. das klassische Regressionsmodell eignen sich i.a. aufgrund einschränkender simplistischer Modellannahmen nicht, um die Zusammenhänge und die Entwicklung dieser ökonomischen Phänomene sachgerecht abzubilden. Besondere Eigenschaften wie Ausreisser (z.B. Messfehler), Strukturbrüche (z.B. infolge politischer Entscheidungen), stochastische Trends (z.B. durch den technologischen Fortschritt) oder wandelnde Volatilitäten (z.B. infolge negativer oder positiver Ankündigungen auf den Finanzmärkten), die in der einen oder anderen Form Beobachtungen über Wirtschaftsprozesse prägen, führen zu unbrauchbaren Zerrbildern der Realität, wenn sie methodisch nicht angemessen berücksichtigt werden. Deshalb sind für die bessere Erklärung allgemeinere Modelle notwendig, deren Grundzüge und Anwendungsfelder im Modul Ökonometrie II vorgestellt werden. Der Besucher des Moduls erfährt anhand praktischer Beispiele aus aktuellen F&E-Projekten eindrücklich Probleme und Einschränkungen klassischer statistischer Ansätze. Danach lernt er diese methodisch bedingten Limitationen anhand geeigneter verallgemeinerter Methoden zu umgehen. Schliesslich erlernt er eine sachgerechte Analyse ökonomischer Phänomene anhand geeigneter statistischer Instrumente.

Lerninhalt:

- Grenzen klassischer Ansätze
- Einfache praxisrelevante Verallgemeinerungen
- Ausreisser: Robuste Schätzverfahren
- Unbeobachtbare erklärende Variablen: 2SLS
- Risiko und bedingte Volatilitäten: ARCH/GARCH/TGARCH-Prozesse
- Nicht-lineare Modelle als Ergänzung zu klassischen Ansätzen
- Strukturbrüche und stochastische Trends
- Zustandsraummodelle und der Kalman-Filter

Vorkenntnisse:

Ökonometrie 1

Durchführung:

Unterrichtsart	Anzahl Lektionen pro Woche
Vorlesung	14x(3L+2L)
Übung/Praktika	7x2L
Gruppenunterricht	
Blockunterricht	
Seminar	

Leistungsnachweise:

Laut Tabelle oder gemäss schriftlicher Festlegung des Dozierenden zu Semesterbeginn!

Anzahl	Art	Gewichtung
1	Modulendprüfung	4,5
1	Prüfungen während Unterrichtszeit	1,5
	Weitere Leistungsnachweise	

Unterrichtssprache:

Deutsch

Unterrichtsunterlagen:

Skriptum, Übungsunterlagen, Scriptfiles.

Mills T (2000). The Econometric Modelling of Financial Time Series.

Bemerkungen:

-