

t.OEKM2 - Ökonometrie 2

Kursverantwortung: Marc Wildi, wlmr
Credits: 6
Schuljahr: 2010/2011
Zuletzt gespeichert: 24.11.2010 16:35

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 Mod

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 Erg

Vorkenntnisse:

-

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:

-