

## t.OEKO2 - Ökonometrie 2

**Kursverantwortung:** Marc Wildi, wlmr  
**Credits:** 4  
**Schuljahr:** 2010/2011  
**Zuletzt gespeichert:** 07.09.2010 07:55

### Lernziel:

Ökonomische Phänomene kennzeichnen sich durch eine Reihe statistisch `unvorteilhafter' Bedingungen:

- Veränderliche Niveaus (stochastische Trends)
- Veränderliche Volatilitäten
- Veränderliche Abhängigkeiten
- Ausreisser
- Strukturbrüche (`plötzliche' anhaltende Veränderungen)

Aufgrund enger bzw. restriktiver Modellannahmen eignen sich deshalb die meisten klassischen Ansätze (z.B. Regression) nicht oder nur bedingt zur Analyse solcher Reihen. In diesem Modul werden statistische Ansätze vorgestellt welche die obigen Punkte (nicht-Stationarität) methodisch-formal geeignet angehen.

### Lerninhalt:

- Klassische/robuste Regression
- GARCH-Prozesse
- Zustandsraummodelle (Kalman-Filter)
- Echtzeitfilter

### Vorkenntnisse:

-

### Durchführung:

Unterrichtsart	Anzahl Lektionen pro Woche
Vorlesung	Hälfte
Übung/Praktika	Hälfte
Gruppenunterricht	
Blockunterricht	
Seminar	

### Leistungsnachweise:

Laut Tabelle oder gemäss schriftlicher Festlegung des Dozierenden zu Semesterbeginn!

Anzahl	Art	Gewichtung
	Modulendprüfung	
	Prüfungen während der Unterrichtszeit	eine Zwischenprüfung
	Weitere Leistungsnachweise	

### Unterrichtssprache:

Deutsch

---

**Unterrichtsunterlagen:**

Skriptum, R-Code

---

**Bemerkungen:**

-