

t.OEKO2 - Ökonometrie 2

Kursverantwortung: Marc Wildi, wlmr
verantwortliche OE:
ECTS: 4
Schuljahr: 2012/2013
Zuletzt gespeichert: 22.01.2013 16:43

Fachkompetenz:

-

Methodenkompetenz:

-

Sozialkompetenz:

-

Selbstkompetenz:

-

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
Blockunterricht	

Leistungsnachweise:

Laut Tabelle oder gemäss schriftlicher Festlegung des Dozierenden zu Semesterbeginn!

Bezeichnung	Art	Form	Umfang	Bewertung	Gewichtung
Leistungsnachweise während Unterrichtszeit					
Semesterendprüfung					

Unterrichtssprache:

Deutsch

Unterrichtsunterlagen:

Skriptum, R-Code

Ergänzende Literatur:

-

Bemerkungen:

-