

## Zeitreihenökometrie – Übungsblatt 5

1. Importieren Sie die Zeitreihen aus dem Excel File ``data.xls`` in Matlab
2. Schätzen Sie ein bi-variates VAR-Modell (reales GDP und Kernrate des Preisindex oder Zielrate der Federal Funds). Die Variablen GDP und P gehen dabei in Differenzen der logarithmierten Werte ein, die Zinsen werden in Niveauewerten verwendet.  
(zur Lösung siehe var\_est.m)
3. Optimieren Sie die Anzahl der berücksichtigten Verzögerungen über ein geeignetes Informationskriterium.
4. Überprüfen Sie die Stabilität des geschätzten Modells.  
(zur Lösung siehe var\_stab.m)
5. Ist Variable P in Ihrem Modell granger-kausal für Variable GDP?  
(zur Lösung siehe var\_granger.m)
6. Berechnen Sie die Impuls-Antworten für Variable GDP auf einen geldpolitischen Impuls. Verwenden Sie die Cholesky Dekomposition zur Berechnung der Impuls Antwort Folgen.  
(zur Lösung siehe var\_IRs.m)