

Vorlesung: Empirische Ökonometrie (Zeitreihenanalyse)

Zeit: Dienstag, 16-19 Uhr
Ort: Ludwigstraße 28, Raum 26

Übung: Freitag, 8-10, CIP-Labor (Herr Mayr)

Gliederung:

1. Einführung
2. Univariate Zeitreihenmodelle für stationäre Variable (ARMA-Modelle)
3. Prognosen mit ARMA-Modellen
4. Univariate Zeitreihenmodelle für nichtstationäre Variable
5. Vektorautoregressive Systeme und Kausalitätsanalysen
6. Ko-Integration und Fehler-Korrektur-Modelle

Literatur:

Francis Diebold (1998), Elements of Forecasting. South-Western College Publishing

Philip Hans Franses (1998), Time Series Models for Business and Economic Forecasting. Cambridge University Press

James Hamilton (1994), Time Series Analysis. Princeton University Press

Andrew Harvey (1993), Time Series Models. MIT Press

Helmut Lütkepohl (2006), New Introduction to Multiple Time Series Analysis. Springer Verlag

Helmut Lütkepohl / Markus Krätzig (eds.) (2004), Applied Time Series Econometrics. Cambridge University Press

Horst Rinne / Katja Specht (2002), Zeitreihen. Statistische Modellierung, Schätzung und Prognose. Vahlen Verlag

Rainer Schlittgen / Bernd Streitberg (2001), Zeitreihenanalyse. Oldenbourg Verlag

Hinweis: Sie erhalten ein Skript, wenn Sie mir ein email mit entsprechendem Betreff an

gebhard.flaign@lrz.uni-muenchen.de

schicken.