



Basistechniken I – Regressionsanalyse

Dieses Seminar vermittelt Ihnen die Grundlagen der angewandten Regressionsanalyse. Nach einer theoretischen Einführung werden praxisnahe Fallbeispiele aus der Finanzmarktanalyse (zu Aktienmarkt, Wechselkursen und Zinsen) vorgestellt. Dabei wird besonderer Wert auf die korrekte Interpretation der Regressionsergebnisse und die Anwendung von verschiedenen Tests gelegt, mit denen die Güte des verwendeten Modells geprüft werden kann.

Vorkenntnisse

Grundlagen der deskriptiven und schließenden Statistik auf dem Niveau von Grundstudiums- bzw. Bachelorvorlesungen

Zielgruppen

Mitarbeiter aus Banken, Versicherungen, volkswirtschaftlichen Abteilungen, Ministerien und Verbänden, die in ihrer eigenen quantitativen Forschung Regressionsmodelle einsetzen oder die sich häufig mit der Interpretation von Regressionsanalysen befassen.

Ihr Nutzen

- Sie erhalten größere Sicherheit in der Anwendung und Interpretation von Regressionsmodellen.
- Sie erlernen moderne Test- und Schätzverfahren, die immer mehr zu Standards werden, durch eigene Übungen am Computer kennen.

Methoden

Vorträge und Demonstration mit Beispielen aus dem Bereich der Finanzmärkte und Computerübungen mit EViews

Seminardatum, -zeit und -ort:

Das Seminar wird zweimal inhaltsgleich angeboten.

Montag, 12. März 2012, 9:00 bis 17:00 Uhr
ZEW · L 7,1 · 68161 Mannheim

Dienstag, 22. Mai 2012, 9:00 bis 17:00 Uhr
Sorell Hotel Zürichberg, Orellistrasse 21, 8044 Zürich, Schweiz

Basistechniken II – Zeitreihenmodelle

In dieser Veranstaltung stellen wir Ihnen die grundlegenden Modelle der univariaten Zeitreihenanalyse sowohl theoretisch als auch praktisch anhand von Fallbeispielen vor. Typische Anwendungsgebiete der Zeitreihenanalyse sind Wachstumsprognosen mithilfe von Konjunkturdaten sowie die Analyse und Prognose von Geldmengen, Wechselkursen und des Außenhandels. Die Veranstaltung ist in zwei Teile gegliedert. Im ersten Teil stehen die Modelle, ihre theoretischen Eigenschaften und Anwendungsmöglichkeiten im Vordergrund. Im zweiten Teil bietet dieses Seminar die Möglichkeit, unter Anleitung selbst Zeitreihen zu modellieren und Prognosen zu erstellen.

Vorkenntnisse

Grundkenntnisse der Ökonometrie (Inhalte, die durch das Seminar „Ökonometrie – Eine praxisorientierte Einführung“ abgedeckt sind.)

Zielgruppen

Mitarbeiter aus Banken, Versicherungen, Ministerien und Verbänden, die entweder daran interessiert sind, eigenständig mit den Verfahren der angewandten Zeitreihenanalyse zu arbeiten oder verstehen wollen, welche Vorteile die Zeitreihenanalyse gegenüber anderen Verfahren der Ökonometrie hat.

Ihr Nutzen

- Sie erlernen Schätz- und Prognosetechniken und deren Anwendung.
- Sie erlangen Kenntnisse über die Modellierung von Zeitreihen, für die es zurzeit keine überzeugenden ökonomischen Modelle gibt, die aber gleichwohl wichtig für die Einschätzung der aktuellen Lage einer Volkswirtschaft sind.

Methoden

Vortrag und Demonstration der Techniken anhand von Beispielen, Erstellung von Modellen und Prognosen in eigener Regie am PC (EViews)

Seminardatum, -zeit und -ort:

Das Seminar wird zweimal inhaltsgleich angeboten.

Dienstag, 13. März 2012, 9:00 bis 17:00 Uhr

ZEW · L 7,1 · 68161 Mannheim

Mittwoch, 23. Mai 2012, 9:00 bis 17:00 Uhr

Sorell Hotel Zürichberg, Orellistrasse 21, 8044 Zürich, Schweiz

Programm

Regressionsanalyse

Interpretation des Regressionsoutputs von EViews

- ◉ F-Test, Informationskriterien, P-Werte usw.
- ◉ Vorgehensweise bei Tests (Nullhypothese und Alternativhypothese, einseitige und zweiseitige Tests)

Schätzverfahren

- ◉ Kleinste-Quadrate-Methode
- ◉ Maximum-Likelihood-Methode

Likelihood-basierte Tests

- ◉ Likelihood-Ratio-Test
- ◉ Wald-Test
- ◉ Lagrange-Multiplier-Test

Regressionsdiagnose

- ◉ Autokorrelation
- ◉ Heteroskedastie
- ◉ Multikollinearität

Zeitreihenmodelle

- ◉ Grundlagen der angewandten Zeitreihenanalyse
- ◉ Autoregressive Moving-Average-Modelle und ARIMA-Modelle
- ◉ Saisonale Zeitreihenmodelle
- ◉ Prognosen

Referenten



Prof. Jürgen Kähler, Ph.D., Research Associate am ZEW und Professor für Volkswirtschaftslehre an der Universität Erlangen-Nürnberg, baute nach der Gründung des ZEW den Forschungsbereich „Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement“ auf und leitete ihn. Er promovierte an der LSE und war fünf Jahre lang Lecturer in Finance an der University of Exeter.



Prof. Dr. Martin Kukuk, Inhaber des Lehrstuhls für Ökonometrie an der Universität Würzburg, war im Anschluss an seine Promotion an der McMaster University, Hamilton/Ontario in Kanada tätig. Nach Stationen an der Universität Konstanz, dem ZEW in Mannheim und der Universität Tübingen habilitierte er dort im Fach Ökonometrie und Statistik. Danach folgte eine Rufnahme an die Universität Magdeburg.

Qualifizierungsprogramm Ökonometrie

Das ZEW bietet neben diesen Veranstaltungen noch weitere Ökonometrie-Seminare an.

GRUNDKURSE ÖKONOMETRIE

Ökonometrie
Eine praxisorientierte
Einführung

Basistechniken I
Regressionsanalyse

Basistechniken II
Zeitreihenmodelle

AUFBAUKURSE FINANZMARKTÖKONOMETRIE

**Modellierung von Zinsen
und Aktienkursen I**
Vektor-Autoregressive
Modelle

**Modellierung von Zinsen
und Aktienkursen II**
Nichtstationäre Zeitreihen
und Kointegration

**Modellierung von Zinsen
und Aktienkursen III**
Erstellung von
Prognosemodellen

AUFBAUKURSE PANELÖKONOMETRIE

Panelökonometrie
Schätzung linearer statischer und stationärer dynamischer Modelle

Panelökonometrie
Schätzung nichtstationärer
Modelle

Panelökonometrie
Schätzung binärer und
zensierter Modelle

Alle Seminare aus dem Qualifizierungsprogramm Ökonometrie können einzeln gebucht werden. Dies hat den Vorteil, dass Sie die einzelnen Seminare frei kombinieren und damit Ihr Programm nach Ihren individuellen Vorkenntnissen zusammenstellen können. Die Grundlagenkurse vermitteln Ihnen bei Bedarf die notwendigen Vorkenntnisse für die Aufbaukurse.

Weitere Informationen zu den Seminaren finden Sie unter www.zew.de/weiterbildung

Allgemeine Informationen

Seminargebühr

Die Seminargebühr beträgt EUR 570,- (zzgl. 7% USt.) für die Seminare in Mannheim und CHF 975,- (umsatzsteuerfrei) für die Seminare in Zürich. Die Gebühr beinhaltet Schulungsunterlagen, Pausen- und Veranstaltungsgetränke sowie das Mittagessen.

Die Teilnehmerzahl ist begrenzt.

Rabattsystem

Mehrfachbuchung: Das ZEW gewährt bei Buchung desselben Seminars durch verschiedene Mitarbeiter einer Institution einen Mengenrabatt von 10 Prozent ab dem zweiten Teilnehmer auf die reguläre Seminargebühr. Sollte ein Teilnehmer mehrere Seminare gleichzeitig buchen, erhält er ab dem zweiten Seminar 10 Prozent Rabatt auf die reguläre Seminargebühr.

Sonderrabatt: Angehörige der WGL, von Universitäten, Fachhochschulen und außeruniversitären öffentlichen Forschungseinrichtungen, Angehörige von Bundes- und Landesministerien/-behörden sowie von der zuständigen Steuerbehörde nach § 52 Abgabenordnung (AO) anerkannte, gemeinnützige Organisationen erhalten 30 Prozent Rabatt auf die reguläre Seminargebühr.

Seminare in Zürich: Bei Buchung eines Seminars bis spätestens 6 Wochen vor Seminarbeginn, gewährt das ZEW einen Preisnachlass von 15 Prozent auf die reguläre Seminargebühr.

Einzelne Rabatte sind nicht aufsummierbar.

Unsere Geschäfts- und Teilnahmebedingungen finden Sie unter www.zew.de/agbs

Anmeldung

Bitte melden Sie sich zur Seminarpartizipation über das Internet (www.zew.de/weiterbildung) an.

Seminarorganisation

Bei Fragen zur Seminarorganisation bzw. zu Übernachtungsmöglichkeiten wenden Sie sich bitte an Vera Pauli, Telefon: 0621/1235-124, Fax: 0621/1235-125, E-Mail: pauli@zew.de

Für unsere Teilnehmer sind Zimmerkontingente mit Sonderkonditionen in unseren Partnerhotels in ZEW-Nähe reserviert. Auf Wunsch übernimmt das ZEW Ihre Zimmerreservierung. Die Übernachtungskosten sind vom Teilnehmer direkt mit dem Hotel abzurechnen. Für das Seminar in Zürich nennen wir Ihnen gerne auf Anfrage Hotelunterkünfte und kümmern uns um die Reservierung.



Das ZEW arbeitet auf dem Gebiet der anwendungsbezogenen empirischen Wirtschaftsforschung. Seine zentralen Aufgaben sind die wirtschaftswissenschaftliche Forschung, die wirtschaftspolitische Beratung sowie der Wissenstransfer. Dabei wendet sich das Institut an Entscheider in Politik, Wirtschaft und Verwaltung, an Wissenschaftler im In- und Ausland sowie an die interessierte Öffentlichkeit.

Forschungsschwerpunkte des Instituts sind: Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement; Arbeitsmärkte, Personalmanagement und Soziale Sicherung; Industrieökonomik und Internationale Unternehmensführung; Unternehmensbesteuerung und Öffentliche Finanzwirtschaft; Umwelt- und Ressourcenökonomik, Umweltmanagement; Informations- und Kommunikationstechnologien; Wachstums- und Konjunkturanalysen; Wettbewerb und Regulierung.

Weitere Informationen erhalten Sie unter www.zew.de oder www.zew.eu und von der Presse- und Öffentlichkeitsarbeit des ZEW:

- Gunter Grittmann, Telefon: 0621/1235-132, E-Mail: grittmann@zew.de
- Kathrin Böhmer, Telefon: 0621/1235-103, E-Mail: boehmer@zew.de

Der Servicebereich „Wissenstransfer und Weiterbildung“

Das ZEW verfügt als einziges deutsches Wirtschaftsforschungsinstitut über einen eigenen Weiterbildungsbereich, um die Ergebnisse der wissenschaftlichen Forschungsarbeit des Instituts praxisnah an Fach- und Führungskräfte aus Unternehmen und Institutionen zu vermitteln. Die enge Kooperation zwischen Wissenschaftlern des ZEW und exzellenten Praktikern ermöglicht eine wissenschaftlich fundierte und zugleich praxisnahe Weiterbildung.

Das Angebot des ZEW gliedert sich in zwei Teile. Es umfasst zum einen Expertenseminare und zum anderen die spezifische Weiterbildung für Unternehmen und Institutionen.

Expertenseminare

- Methodenkompetenz
- Qualifizierungsprogramm Ökonometrie
- Finanzmarktanalyse und -management
- Unternehmensführung und Organisation

Spezifische Weiterbildung für Unternehmen und Institutionen

- Methodenkompetenz
- Volkswirtschaftliche und betriebswirtschaftliche Kompetenz
- Kompetenzen in der Vermittlung von Soft Skills

Hinweis: Die verwendeten männlichen Bezeichnungen dienen ausschließlich der besseren Lesbarkeit und gelten ausdrücklich für beide Geschlechter.

Foto Seite 1: Digitalstock; Seite 2: © Carina Pfann – Fotolia.com; © Jozsef Szasz-fabian – Fotolia.com

ZEW

Zentrum für Europäische
Wirtschaftsforschung GmbH

L 7, 1 · 68161 Mannheim
Postfach 103443 · 68034 Mannheim
Telefon 0621/1235-01 (Zentrale)
Telefax 0621/1235-224
Internet www.zew.de · www.zew.eu



Leibniz
Gemeinschaft