

Modellierung von Zinsen und Aktienkursen III

Erstellung von Prognosemodellen

07. Mai 2008, Mannheim

In diesem Seminar lernen Sie, ökonometrische Prognosemodelle für Finanzmarkt-Zeitreihen erfolgreich zu erstellen und die Güte der Modelle umfassend zu bewerten. Alle Übungen und Praxisbeispiele werden mit EViews durchgeführt. Eine umfangreiche Übung (Vector-Error-Correction-Modell für Zusammenhänge zwischen US-Aktienmarkt und Realwirtschaft) dient dazu, die Anwendung der Methoden in EViews zu vertiefen.

Ihr Nutzen

- Sie erstellen Prognosemodelle für Finanzmarkt-Zeitreihen.
- Sie vermeiden häufige Fehler bei der Modellerstellung.
- Sie erlernen die Methoden mit Hilfe ausführlicher PC-Übungen.

Zielgruppen

Fach- und Führungskräfte aus den Bereichen Volkswirtschaftliche Analyse, Investment Research, Portfolio Management, Kapitalmarktanalyse und Unternehmensanalyse

Vorkenntnisse

Gute Kenntnisse ökonometrischer Methoden, insbesondere Vektor-Auto-regressiver Modelle und deren Anwendung im Rahmen nicht-stationärer Zeitreihen (Vector-Error-Correction-Modelle)

(Inhalte, die durch die Seminare „Modellierung von Zinsen und Aktienkursen I und II“ abgedeckt werden)

Methoden

Vorträge, Übungen am PC, Praxisbeispiele

Seminargebühr

Die Gebühr beträgt EUR 550,- (zzgl. 7% USt.).

Bitte beachten Sie unser Rabattsystem auf Seite 16.

Die Teilnehmerzahl ist begrenzt.

Seminarinhalte am 07. Mai 2008

Modellierung von Zinsen und Aktienkursen III
Erstellung von Prognosemodellen

Erstellung von Prognosemodellen

- Struktur eines Prognosemodells
- Data Mining
- Datenauswahl
- Granger-Kausalitätstests

Modellauswahl

- Bestimmung der Modellstruktur
- Tests auf Strukturkonstanz

Bewertung der Prognosegüte

- Punktprognosen
- Konstruktion der Prognosen
- Kennzahlen der Prognosegüte
- Statistische Tests
- Richtungsprognosen

Workshop „Aktienmarkt und Realwirtschaft: USA“

Seminarleiter und Referent

Dr. Michael Schröder, ZEW



Prof. Dr. Uwe Hassler, Lehrstuhl für Statistik und Methoden der Ökonometrie an der Goethe-Universität Frankfurt

Nach seiner Habilitation an der FU Berlin in den Fächern Statistik und Ökonometrie, nahm Herr Hassler Lehraufträge an der Ludwig-Maximilians-Universität München und an der Westfälischen Wilhelms-Universität Münster wahr. Es folgte eine Professur an der TU Darmstadt.



Marcus Kappler, Forschungsgruppe „Wachstums- und Konjunkturanalysen“

Marcus Kappler studierte an der Universität Tübingen, der University of Maryland, USA und der Freien Universität Berlin Volkswirtschaftslehre. Seine Forschungsschwerpunkte liegen im Bereich der Makroökonomie sowie der Makroökometrie.



Prof. Jürgen Kähler, Ph.D., ZEW- Forschungsprofessor und Professor für Volkswirtschaftslehre an der Universität Erlangen-Nürnberg

Nach seiner Promotion war er am ZEW beschäftigt, wo er den Forschungsbereich „Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement“ aufbaute und leitete. Anschließend war er fünf Jahre lang Lecturer in Finance an der University of Exeter.



Matthias Köhler, Forschungsbereich „Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement“

Matthias Köhler studierte Volkswirtschaftslehre an der Universität Bayreuth und der University of Delaware mit den Studienschwerpunkten Geld und Banken sowie Internationale Wirtschaft. Sein Schwerpunkt am ZEW ist die Integration der Kapitalmärkte.



Prof. Dr. Martin Kukuk, Lehrstuhl für Ökonometrie an der Universität Würzburg

Im Anschluss an seine Promotion war er 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.



Dr. Bettina Peters, Forschungsbereich „Industrieökonomik und Internationale Unternehmensführung“

Dr. Bettina Peters studierte an der Christian-Albrechts-Universität zu Kiel Volkswirtschaftslehre mit den Schwerpunkten Ökonometrie und Statistik. Nach ihrer Mitarbeit an der Universität Kiel beschäftigt sie sich am ZEW vor allem mit der Analyse des Mannheimer Innovationspanels.



Andreas Schrimpf, Forschungsbereich „Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement“

Andreas Schrimpf studierte Volkswirtschaftslehre an den Universitäten Aberdeen, Tübingen und Barcelona mit dem Studienschwerpunkt Wachstums- und Innovationstheorie, Ökonometrie sowie Finanzwirtschaft. Am ZEW befasst er sich vor allem mit der empirischen Kapitalmarktforschung (Asset Pricing).



Dr. Michael Schröder, Leiter des Forschungsbereiches „Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement“, ZEW

Nach seiner Promotion arbeitete er bei einer internationalen Investmentbank in Frankfurt/ Main im Bereich Investment Research. Seit 1995 ist Dr. Schröder am ZEW Leiter des Forschungsbereiches „Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement“.



Prof. Dr. Peter Winker, Professor für Statistik und Ökonometrie an der Justus-Liebig-Universität Gießen

Nach seiner Habilitation in Mannheim war er an der International University in Germany, Bruchsal und dem Lehrstuhl für Wirtschaftswissenschaften, insbesondere Ökonometrie, an der Universität Erfurt beschäftigt.