

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 mit Hilfe von Konjunkturdaten sowie Analyse und Prognose von Geldmengen, Wechselkursen und Außenhandel. Die Veranstaltung ist in zwei Teile gegliedert. Im ersten Teil stehen die Modelle, ihre theoretischen Eigenschaften und Anwendungsmöglichkeiten im Vordergrund. Im zweiten Teil bieten wir Ihnen die Möglichkeit, unter Anleitung selbst Zeitreihen zu modellieren und Prognosen zu erstellen.

Ihr Nutzen

- Sie erlernen und wenden Schätz- und Prognosetechniken an.
- Sie erhalten 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.

Zielgruppen

Experten von 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.

Vorkenntnisse

Grundkenntnisse der Ökonometrie (Inhalte, die durch das Seminar „Basistechniken I – Regressionsanalyse“ abgedeckt sind)

Methoden

Vortrag und Demonstration der Techniken anhand von Beispielen; Erstellung von Modellen und Prognosen in eigener Regie am PC (Software: EViews). Die theoretische Wissensvermittlung und die praktischen Anwendungsbeispiele sind etwa gleich gewichtet.

Seminargebühr

Die Gebühr beträgt EUR 550,- (zzgl. 7% USt.).
Bitte beachten Sie unser Rabattsystem auf Seite 16.
Die Teilnehmerzahl ist begrenzt.

Grundlagen statistischer Hypothesentests

- Grundlagen der angewandten Zeitreihenanalyse
- Autoregressive Moving-Average-Modelle (ARMA)
- Stationarität und Invertierbarkeit

Integrierte ARMA-Modelle

- Prognosen
- Saisonale Zeitreihenmodelle
- Praktische Vorgehensweise

Analyse und Prognose verschiedener Datenreihen am PC mit EViews

Seminarleiter und Referent

Dr. Michael Schröder, ZEW

Prof. Dr. Martin Kukuk, Universität Würzburg



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.