

Zeitreihenanalyse



Modulnummer 333123004	Workload 225 h	Umfang 7,5 LP	Dauer Modul 1 Semester	Turnus jährlich, Sommer
Modulbeauftragter	Prof. Dr. Jörg Breitung			
Anbietendes Institut (ggf. Abt.)	Wirtschaftswissenschaftlicher Fachbereich			
Verwendbarkeit des Moduls	Studiengang		Modus	Fachsemester
	Bachelor of Science Volkswirtschaftslehre		Wahlpflicht/ Methoden	5. bzw. 6. Semester
Lernziele	Die Teilnehmer sollen die grundlegenden Methoden zur Beschreibung und Prognose von Zeitreihen erlernen und auf ökonomische Datenreihen anwenden können. Sie sollen dadurch insbesondere ein vertieftes Verständnis für die heute in wirtschaftswissenschaftlicher Theorie und Praxis zum Standard gehörenden und auch in den gängigen statistischen Softwarepaketen implementierten Techniken der Zeitreihenanalyse erwerben..			
Schlüsselkompetenzen	IT-Kompetenz			
Inhalte	Zunächst werden Grundlagen der Modellierung von Zeitreihen auf Basis von ARIMA-Prozessen behandelt. Zur Auswahl geeigneter Modelle werden alternative Methoden vorgestellt und mit einander verglichen. Die Spezifikation und Schätzung trendbehafteter Zeitreihen erfolgt mit dem Instrumentarium der nichtstationären Zeitreihenanalyse.			
Teilnahmevoraussetzungen	Keine			
Veranstaltungen	Lehrform, Thema, Gruppengröße		SWS	Workload [h]
	Vorlesung mit Übung		2+2	(K) 60 (S) 165
Prüfung(en)	Prüfungsform(en)		Benotung	
	mündlich oder schriftlich		benotet	
Studienleistungen u.a. als Zulassungsvoraussetzung zur Modulprüfung	Studienleistung(en)			
	Keine			
Sonstiges	Das Modul baut auf den Inhalten der Pflichtmoduls <i>Mathematische Methoden für Wirtschaftswissenschaftler B: Vektoralgebra und Ökonometrie</i> auf.			

(K) = Kontaktzeit, (S) = Selbststudium

Stand: Januar 2012