

## Wirtschaftswissenschaftliches Proseminar

Prof. Dr. Peter Winker

Nicola Stork

**e-mail:** Peter.Winker@wirtschaft.uni-giessen.de  
Nicola.Stork@wirtschaft.uni-giessen.de

Im Rahmen des Proseminars werden eine Reihe von Kompetenzen erworben: Erweiterung der ökonometrischen Methodenkenntnisse, Kompetenz im eigenständigen Umgang mit Ökonometriesoftware (EViews), eigene empirische Arbeit sowie Vorstellung von Ergebnissen in schriftlicher Form und im Vortrag. Dadurch sollen die Studierenden in das empirische und wissenschaftliche Arbeiten eingeführt werden. Insbesondere sollen auch Aspekte wie die Einordnung der eigenen Fragestellung in den wissenschaftlichen Kontext, der Bezug von Daten aus öffentlich zugänglichen Datenbanken, die Interpretation der eigenen Erkenntnisse und deren Präsentation im Rahmen des Proseminars adressiert werden.

Es werden Verfahren der ökonometrischen Analyse multivariater Zeitreihen (VAR-Modelle) präsentiert und auf Beispiele aus den Bereichen Makroökonomie und Finance praktisch angewendet.

Das Proseminar umfasst neben den Präsentationen am Ende des Semesters auch einen kleinen Vorlesungsteil, in dem die Methoden eingeführt werden und einen Projektteil, in dem die eigenständige Umsetzung der Methoden für die spezifischen Anwendungen im Mittelpunkt stehen wird.

## 1 Mögliche Themen für die Projektarbeiten

Die zu bearbeitenden Themen werden in der ersten Veranstaltung vorgestellt und verteilt.

## 2 Literatur

Einführend (Allgemein):

- Stock & Watson, *Introduction to Econometrics*

- Winker, *Empirische Wirtschaftsforschung und Ökonometrie*
- Wooldridge, *Introductory Econometrics: A modern Approach*

Einführend (VAR Modelle):

- Winker, Vektor Autoregressive Modelle, in Schröder (Hrsg.): Finanzmarktökonometrie, Schäffer-Poeschel, Stuttgart 2012 (2. Aufl.), 179-226 \*\*\*

Weiterführend

- Heij et al., *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*, 2004, Chapter 7.6
- Lütkepohl, Vector Autoregressive and Vector Error Correction Models, in: Lütkepohl und Kräzig (Hrsg): *Applied Time Series Econometrics*, Cambridge University Press 2004, 86–158
- Lütkepohl, *New Introduction to Multiple Time Series Analysis*, Springer, Berlin 2007 (2. korr. Druck), Kapitel 3–4

EViews

- EViews Illustrated for Version 8 <http://www.eviews.com/illustrated/illustrated.html>
- Danijela Markovic, A guide to EViews, Humboldt Universität zu Berlin, Institut für Statistik und Ökonometrie (leicht veraltet)
- EViews Quick Reference

Weitere Literature finden Sie in den Slides.

### **3 Voraussetzungen für erfolgreiche Teilnahme**

- Anfertigung einer mit mindestens „ausreichend“ (4,0 bzw. 5 Punkte) bewerteten schriftlichen Darstellung der Projektergebnisse (Gewichtung 2/3).
- Präsentation der eigenen Arbeit im Rahmen des Proseminars (ca. 20 min) (Gewichtung 1/3)
- Absolvieren der Grundlagenkurse in Statistik/Ökonometrie

## 4 Weitere Informationen:

Kreditpunkte:	6
Seminar-Wochenstunden:	4
Termine:	montags: 14:15 - 15:45 Uhr donnerstags: 08:15 - 09:45 Uhr
Anmeldung:	über S3C
Abgabetermin der Arbeiten:	11.01.2016 Sekretariat Professur Winker
Versand der Arbeit als PDF-Datei an:	Peter.Winker@wirtschaft.uni-giessen.de Nicola.Stork@wirtschaft.uni-giessen.de
Umfang der Arbeit:	dem Inhalt entsprechend (ca. 10 Seiten Text)
Formale Anforderungen:	siehe Leitfaden

## 5 Zeitplan

---

KW	Montag		Donnerstag	
42	12.10.2015	Kick-off	15.10.2015	Vorlesung
43	19.10.2015	Vorlesung	22.10.2015	(Übung)
44	26.10.2015	Übung	29.10.2015	Vorlesung
45	02.11.2015	Vorlesung	05.11.2015	Übung
46	09.11.2015	Vorlesung	12.11.2015	Vorlesung
47	16.11.2015	Vorlesung	19.11.2015	
48	23.11.2015	Übung	26.11.2015	Übung
49	30.11.2015	Übung	03.12.2015	
50	07.12.2015		10.12.2015	
51	14.12.2015		17.12.2015	
	Ferien - Achtung PC-Pool geschlossen			
3	<b>11.01.2016</b>	<b>Abgabe</b>	14.01.2016	
4	18.01.2016		21.01.2016	
5	25.01.2016	Vorträge	28.01.2016	Vorträge
6	01.02.2016	Vorträge	04.02.2016	Vorträge
7	08.02.2016	Vorträge	11.02.2016	Vorträge

---