

<b>Modul MW09: Multivariate Statistik und Ökonometrie</b>				<b>Studiengang:</b>	M
<b>Modultyp:</b>	<b>ECTS-Punkte:</b>	<b>Workload:</b>	<b>Studiensemester:</b>	<b>Dauer des Moduls:</b>	
Wahlpflicht	16	480	3. und 4.	Zwei Semester	
<b>Lehrveranstaltungen:</b>			<b>Kontaktzeit:</b>	<b>Selbststudium:</b>	<b>Geplante Gruppengröße:</b>
Kurs 1: Vertiefung Multivariate Statistik und Ökonometrie (2 SWS)			30 h	90 h	20
Kurs 2: Gruppenarbeit zu Vertiefung Multivariate Statistik und Ökonometrie (2 SWS)			30 h	90 h	20
Kurs 3: Vertiefung Prognoseverfahren und Finanzmarktstatistik (2 SWS)			30 h	90 h	20
Kurs 4: Gruppenarbeit zu Vertiefung Prognoseverfahren und Finanzmarktstatistik (2 SWS)			30 h	90 h	20
<b>Lernziele und Kompetenzen:</b>					
<p>Ziel der Kurse dieses Moduls ist es, die Studierenden zu selbständiger empirischer Forschungsarbeit anzuleiten, die über die Anwendung der Verfahren aus dem Modul MS00 hinausgehen:</p> <p>Die Kurse 1 und 2 vertiefen die Kenntnisse aus MS00 im Hinblick auf weitere multivariate Techniken und das Schätzen von Mehrgleichungsmodellen. In den Kursen 3 und 4 werden in der Praxis häufig benutzte Prognoseverfahren vorgestellt und statistisch-ökonometrische Methoden in ihrer Anwendung bei Finanzmarktdaten besprochen. Die Kurse 3 und 4 sind deshalb besonders für diejenigen Studierenden interessant, die sich später beruflich intensiver mit dem Bereich Banken und Finanzdienstleistungen beschäftigen wollen.</p>					
<b>Inhalte:</b>					
<p>Diese Wahlpflichtkurse basieren auf der Pflichtveranstaltung MS00 „Einführung in die Empirische Wirtschaftsforschung“ und vertiefen bzw. ergänzen das dort vermittelte Methodenspektrum.</p> <p><i>Kurse 1 und 2: Vertiefung Multivariate Statistik und Ökonometrie</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Varianz- und Kovarianzanalyse</li> <li>- Diskriminanzanalyse</li> <li>- Kanonische Korrelation</li> <li>- Multidimensionale Skalierung</li> <li>- Verzögerte Variablen und Distributed-Lag-Modelle</li> <li>- Identifikation ökonometrischer Mehrgleichungsmodelle</li> </ul>					

- Einzelgleichungsschätzverfahren für interdependente Systemen
- Simultane Schätzverfahren für interdependente Systeme
- Gütebeurteilung interdependenter Modellschätzungen

*Kurse 3 und 4: Vertiefung Prognoseverfahren und Finanzmarktstatistik*

- Prognose mit Regressionsmodellen
- Prognose mit exponentiellen Glättungsmethoden
- Prognose mit Zeitreihenmodellen (ARIMA-Modelle)
- Vektorautoregressive Modelle (VAR-Modelle)
- Test auf Nichtstationarität
- Kointegration
- Modell-Volatilität und Korrelation (ARCH- und GARCH-Modelle)

**Lehrformen:**

Plenum und Gruppenarbeit

**Verwendbarkeit des Moduls:**

M.Sc. BWL; M.Sc. VWL; M.Sc. Wirtschaftskemie.

**Teilnahmevoraussetzungen:**

Teilnahme an den Kursen zum Modul „Methoden der empirischen Wirtschaftsforschung“.

**Prüfungsformen:**

Die Modulabschlussprüfung erfolgt in Form einer Klausur (120 Minuten).

**Voraussetzungen für die Vergabe von ECTS-Punkten:**

Regelmäßiger Besuch der Kurse und erfolgreich abgelegte Modulabschlussklausur.

Im Masterstudiengang BWL können zusätzlich Leistungspunkte gemäß § 7 der Prüfungsordnung durch Erbringen einer Zusatzleistung erworben werden, indem im Rahmen der Kurse 2 bzw. 4 eine Hausarbeit mit Referat oder eine praktische Projektarbeit mit Referat angefertigt werden.

**Häufigkeit des Angebots:**

In jedem Wintersemester und dem darauf folgenden Sommersemester.

**Stellenwert der Note für die Endnote:**

Die Gesamtnote der Masterprüfung errechnet sich als gewichtetes arithmetisches Mittel aus den Noten der Modulabschlussprüfungen, der Zusatzleistung und der Masterarbeit. Dabei wird die Masterarbeit dreifach gewichtet.

**Modulbeauftragte und hauptamtlich Lehrende:**

Prof. Dr. Horst Degen und Wissenschaftliche Mitarbeiter.

**Sonstige Informationen:**

Aktuelle Informationen auf den Internetseiten der Modulbeauftragten.

Stand: 17.6.2011