**RUPRECHT-KARLS-UNIVERSITÄT HEIDELBERG**
ALFRED-WEBER-INSTITUT FÜR
WIRTSCHAFTSWISSENSCHAFTEN
Prof. Christian Conrad

Sommersemester 2021

# Makroökonometrie

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Vorlesung** | Di | 11:00 | 13:00 | Videos / Online Q&A Sessions |
| **Übung** | Mi | 16:00 | 18:00 | Videos / Online Q&A Sessions |

Die Vorlesung wird als Online-Kurs angeboten und beginnt am 13. April. Die Vorlesungen und Übungen finden via Zoom statt. Alle Unterrichtsmaterialien werden über Moodle bereitgestellt. Das Moodle Passwort ist "MakroOek2021". Die Anmeldung in Moodle ist ab dem 01.04. möglich.

***Kommentar:***

Ökonomische Akteure wie z.B. Zentralbanken, Regierungen, Finanzinstitutionen und Haushalte basieren ihre Entscheidungen unter anderem auf Prognosen makroökonomischer Variablen. Die Erstellung und Evaluation von Prognosen ist somit wesentlicher Bestandteil von vielen Entscheidungsprozessen. Die Vorlesung vermittelt grundlegende Kenntnisse zur uni- und multivariaten Modellierung und Prognose makroökonomischer Variablen wie BIP-Wachstum, Inflation und Arbeitslosigkeit. Der Schwerpunkt der Veranstaltung wird auf der eigenständigen empirischen Anwendung der einzelnen Methoden durch die Kursteilnehmer liegen. Die Inhalte der Vorlesung werden durch methodische und empirische Übungen mit der Ökonometrie-Software EViews vertieft.

***Inhalt:***

1. Makroökonomische Zeitreihen
2. Umfrage-Daten: Survey of Professional Forecasters (FED und EZB)
3. Modellierung von Trend, Saisonalität und Zyklus
4. Dynamische Regressionsmodelle
5. Vektor-Autoregressive Modelle
6. Stochastische Trends und Kointegration
7. Volatilität

***Leistungsnachweis:***

Die Note für diese Vorlesung wird durch eine 90-minütige Klausur am Semesterende festgelegt. Es besteht die Möglichkeit, Zusatzpunkte durch die Abgabe von Aufgabenblättern zu erwerben.

***Voraussetzungen:***

Sie sollten die Pflichtvorlesung Empirische Wirtschaftsforschung erfolgreich abgeschlossen haben.

***Kurssprache:***

Deutsch

***Fachzugehörigkeit:***

PÖ4d

***Literatur:***

Bjørnland, H.C., Thorsrud, L.A. (2015). Applied Time Series for Macroeconomics. Gyldendal Akademisk.
Castle, J., Clements, M., Hendry, D. (2019). Forecasting: An Essential Introduction. Yale University Press.
Diebold, F.X. (2007). Elements of Forecasting. Thomson South-Western.
Diebold, F.X. (2017). Forecasting. Department of Economics, University of Pennsylvania.
Enders, W. (2014). Applied Econometric Time Series. Wiley.
Ghysels, E., Marcellino, M. (2018). Applied Economic Forecasting using Time Series Methods. Oxford University Press.
Hurn, S., Martin, V.L., Phillips, P.C.B., Yu, J. (2020). Financial Econometric Modelling. Oxford University Press.
Stock, J.H., Watson, M.W. (2014). Introduction to Econometrics. Pearson International Edition.