



Qualifizierungsprogramm Ökonometrie

Basistechniken

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen

Panelökonometrie

Weitere
Informationen:



ZEW

Qualifizierungsprogramm Ökonometrie

GRUNDKURSE ÖKONOMETRIE

Ökonometrie

Eine praxisorientierte
Einführung

Basistechniken I

Regressionsanalyse

Basistechniken II

Zeitreihenmodelle

AUFBAUKURSE FINANZMARKTÖKONOMETRIE

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen I

Vektor-Autoregressive
Modelle

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen II

Nichtstationäre Zeitreihen
und Kointegration

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen III

Selbstständig modellieren
und überprüfen

AUFBAUKURSE PANELÖKONOMETRIE

Panelökonometrie I

Schätzung linearer statischer und stationärer dynamischer Modelle

Panelökonometrie II

Schätzung nichtstationärer
Modelle

Panelökonometrie III

Schätzung binärer und
zensierter Modelle

Alle Seminare aus dem Qualifizierungsprogramm Ökonometrie können einzeln gebucht und frei kombiniert werden. Stellen Sie Ihr individuelles Programm nach Ihren Vorkenntnissen zusammen und erwerben Sie bei Bedarf Vorkenntnisse in den Grundlagenkursen.

Weitere Informationen zu den benötigten Vorkenntnissen finden Sie auf der jeweiligen Seminarseite im Internet:

www.zew.de/weiterbildung

In allen Seminaren bearbeiten Sie an von uns bereitgestellten Notebooks praktische Übungen.

Neben den in diesem Flyer vorgestellten Seminaren beinhaltet das Qualifizierungsprogramm Ökonometrie auch das zweitägige Grundlagenseminar „Ökonometrie – Eine praxisorientierte Einführung“. Unter www.zew.de/weiterbildung/674 finden Sie weitere Informationen.

Seminartermine

Grundkurse Ökonometrie

Mittwoch, 04.02.2015, Mannheim:

Basistechniken I – Regressionsanalyse

Donnerstag, 05.02.2015, Mannheim:

Basistechniken II – Zeitreihenmodelle

Aufbaukurse Finanzmarkt-Ökonometrie

Montag, 23.03.2015, Mannheim:

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen I –
Vektor-Autoregressive Modelle

Dienstag, 24.03.2015, Mannheim:

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen II –
Nichtstationäre Zeitreihen und Kointegration

Mittwoch, 25.03.2015, Mannheim:

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen III –
Selbstständig modellieren und überprüfen

Aufbaukurse Panelökonometrie

Dienstag, 05.05.2015, Mannheim:

Panelökonometrie I – Schätzung linearer statischer
und stationärer dynamischer Modelle

Mittwoch, 06.05.2015, Mannheim:

Panelökonometrie II – Schätzung nichtstationärer
Modelle

Donnerstag, 07.05.2015, Mannheim:

Panelökonometrie III – Schätzung binärer und
zensierter Modelle

Basistechniken I – Regressionsanalyse

Dieses Seminar vermittelt Ihnen die Grundlagen der angewandten Regressionsanalyse. Es richtet sich an Personen, die in ihrer eigenen quantitativen Forschung Regressionsmodelle einsetzen oder die sich häufig mit der Interpretation von Regressionsanalysen befassen. Für die Teilnahme sind Grundlagen der deskriptiven und schließenden Statistik notwendig.

Inhalte

Interpretation des Regressionsoutputs von EViews

- F-Test, Informationskriterien, p-Werte usw.
- Vorgehensweise bei Tests (Nullhypothese und Alternativhypothese, einseitige und zweiseitige Tests)

Schätzverfahren

- Kleinste-Quadrate-Methode
- Maximum-Likelihood-Methode
- Likelihood-basierte Tests

Regressionsdiagnose

- Autokorrelation
- Heteroskedastie
- Multikollinearität

Referent

Prof. Jürgen Kähler, Ph.D., Friedrich-Alexander Universität
Erlangen-Nürnberg und ZEW

Weitere Informationen und Anmeldung:

www.zew.de/weiterbildung/662

Basistechniken II – Zeitreihenmodelle

In diesem Seminar stellen wir Ihnen die grundlegenden Modelle der univariaten Zeitreihenanalyse vor. Es richtet sich an Personen, 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. Für dieses Seminar sind Grundkenntnisse der Ökonometrie erforderlich (Inhalte, die durch das Seminar „Ökonometrie – eine praxisorientierte Einführung“ abgedeckt werden).

Inhalte

Grundlagen Statistischer Hypothesentests

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

Integrierte ARMA-Modelle

- Prognosen
- Saisonale Zeitreihenmodelle
- Praktische Vorgehensweise

Referent

Prof. Dr. Martin Kukuk, Julius-Maximilians-Universität Würzburg

Weitere Informationen und Anmeldung:

www.zew.de/weiterbildung/663

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen I

Vektor-Autoregressive Modelle

In diesem Seminar lernen Sie den Einsatz von Vektor-Autoregressiven Modellen zur Modellierung und Prognose von Zeitreihen kennen. Es richtet sich an Fach- und Führungskräfte aus den Bereichen Volkswirtschaftliche Analyse, Unternehmensanalyse, Investment Research, Kapitalmarktanalyse sowie Portfoliomanagement und Vermögensverwaltung. Für dieses Seminar ist ein Grundverständnis der linearen Regressionsanalyse und ihrer praktischen Umsetzung erforderlich (Inhalte, die durch das Seminar „Basistechniken I – Regressionsanalyse“ abgedeckt werden).

Inhalte

Grundidee der Vektor-Autoregressiven Modelle, Modellspezifikation und Schätzung

Interpretation der Schätzergebnisse

- ◉ Granger-Kausalität
- ◉ Impuls-Antwort-Folgen

Prognosen mit Vektor-Autoregressiven Modellen

- ◉ Prognosevarianzzerlegung
- ◉ Überprüfung der Prognosegüte

Referent

Prof. Dr. Peter Winker, Justus-Liebig-Universität Gießen und ZEW

Weitere Informationen und Anmeldung:

www.zew.de/weiterbildung/685

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen II

Nichtstationäre Zeitreihen und Kointegration

In diesem Seminar lernen Sie die korrekte Anwendung fortgeschrittener ökonometrischer Verfahren im Bereich der Zeitreihenanalyse kennen. Es richtet sich an Fach- und Führungskräfte von Institutionen, die sich mit empirischer Finanzmarktforschung und Makroökonomie befassen. Für dieses Seminar sind solide Grundkenntnisse der Ökonometrie erforderlich (Inhalte, die durch die Seminare „Basistechniken I – Regressionsanalyse“ und „Basistechniken II – Zeitreihenmodelle“ abgedeckt werden; zusätzlich Inhalte des Seminars „Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen I“).

Inhalte

- Bedeutung und Auswirkungen von Nichtstationarität
- Stationaritäts- und Einheitswurzeltests
- Kointegration im Eingleichungsmodell (Engle-Granger-Ansatz)
- Fehlerkorrekturmodell
- Kointegration im Mehrgleichungsmodell (Johansen-Verfahren)

Referenten

Prof. Dr. Felix Schindler, Center for Real Estate Studies (CRES) an der Steinbeis-Hochschule Berlin, FERI EuroRating Services AG und ZEW

Prof. Dr. Peter Winker, Justus-Liebig-Universität Gießen und ZEW

Weitere Informationen und Anmeldung:
www.zew.de/weiterbildung/686

Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen III

Selbstständig modellieren und überprüfen

In diesem Seminar lernen Sie, ökonometrische Prognosemodelle für Zeitreihen erfolgreich zu erstellen und die Güte der Modelle umfassend zu bewerten. Es richtet sich an Fach- und Führungskräfte aus den Bereichen Volkswirtschaftliche Analyse, Investment Research, Portfoliomanagement, Kapitalmarkt- und Unternehmensanalyse. Für die Teilnahme an diesem Seminar sind gute Kenntnisse ökonometrischer Methoden, insbesondere Vektor-Autoregressiver Modelle, und deren Anwendung im Rahmen nichtstationärer Zeitreihen (Vector-Error-Correction-Modelle) erforderlich (Inhalte, die durch die Seminare „Zeitreihen analysieren und Prognosen erstellen I und II“ abgedeckt werden.)

Inhalte

- Vorgehensweise bei der Konstruktion von Prognosemodellen
- Überprüfung der Modelleigenschaften
- Modellauswahl und Test der Prognosegüte
- Umfangreiche PC-Übung: Schätzung eines Vector-Error-Correction-Modells für ein praxisrelevantes Beispiel
- Erstellung von Analysen und Prognosen in EViews inklusive der Erstellung von Programmen

Referent

Prof. Dr. Michael Schröder, ZEW und Frankfurt School of Finance & Management

Weitere Informationen und Anmeldung:
www.zew.de/weiterbildung/687

Panelökonometrie I

Schätzung linearer statischer und stationärer dynamischer Modelle

Panelökonometrische Verfahren haben im letzten Jahrzehnt in der angewandten Forschung enorm an Bedeutung gewonnen. Anhand dieser Verfahren werden statistische Daten ausgewertet, die sowohl über eine Querschnitts- als auch über eine Zeitdimension verfügen. Dieses Seminar bietet Ihnen eine breit angelegte Einführung in die Methoden und Modelle der Panelökonometrie. Es richtet sich an empirisch arbeitende Wirtschaftswissenschaftler in Unternehmen, Banken, Verbänden, Ministerien, Hochschulen und außeruniversitären Forschungseinrichtungen. Für die Teilnahme an diesem Seminar sind Grundkenntnisse der Ökonometrie erforderlich (Inhalte, die durch das Seminar „Basistechniken I – Regressionsanalyse“ abgedeckt werden).

Inhalte

Grundmodelle der Panelökonometrie

- Gepoolte Modelle
- Fixed-Effects-Modelle
- Random-Effects-Modelle

Dynamisch lineare Paneldatenmodelle

- Instrumentvariablenschätzer
- GMM-Differenzschätzer (Arellano-Bond)
- System-GMM-Schätzer (Arellano-Bover)
- Spezifikationstests

Referenten

Dr. Bettina Peters, ZEW

Dominik Rehse, ZEW

Weitere Informationen und Anmeldung:
www.zew.de/weiterbildung/676

Panelökonometrie II

Schätzung nichtstationärer Modelle

Im Gegensatz zur mikroökonometrischen Panelanalyse treten bei makroökonometrischen Paneldatensätzen, die üblicherweise aus Länderdaten über lange Zeiträume bestehen, spezielle Probleme auf: trendbehaftete Datenreihen, hohe Autokorrelation, Einheitswurzeln oder Kointegration. Das Seminar bietet Ihnen eine Einführung in diese Thematik und richtet sich an empirisch arbeitende Wirtschaftswissenschaftler in Unternehmen, Banken, Verbänden, Ministerien, Hochschulen und außeruniversitären Forschungseinrichtungen.

Inhalte

- Paneldaten mit EViews: Datenimport und deskriptive Analysen, Ökonometrische Modelle
- (Ko-)Integration
- Panel-Integrationstests: LLC, IPS, Fischer-Test; Taylor/Sarno; KPSS-Test
- Panel-Kointegration und Panel-Fehlerkorrekturmodelle

Referenten

Prof. Dr. Uwe Hassler, Goethe-Universität Frankfurt am Main und ZEW
Dr. Marcus Kappler, E.ON Global Commodities SE

Weitere Informationen und Anmeldung:

www.zew.de/weiterbildung/677

Unsere Referenten



Prof. Dr. Uwe Hassler

Professor für Statistik und Methoden der Ökonometrie an der Goethe-Universität Frankfurt am Main und Research Associate am ZEW



Prof. Jürgen Kähler, Ph.D.

Professor für Volkswirtschaftslehre an der Friedrich-Alexander-Universität Erlangen-Nürnberg und Research Associate am ZEW



Dr. Marcus Kappler

Senior Macro-Analyst, Fundamental Analysis, E.ON Global Commodities SE



Prof. Dr. Martin Kukuk

Inhaber des Lehrstuhls für Ökonometrie an der Julius-Maximilians-Universität Würzburg



Dr. Bettina Peters

Stellvertretende Leiterin im Forschungsbereich Industrieökonomik und Internationale Unternehmensführung am ZEW



Dominik Rehse

Wissenschaftlicher Mitarbeiter im Forschungsbereich „Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement“ am ZEW



Prof. Dr. Felix Schindler

Senior Real Estate Analyst, FERI EuroRating Services AG Bad Homburg, Professor für Immobilien am Center for Real Estate Studies (CRES) Steinbeis-Hochschule Berlin und Research Fellow am ZEW



Prof. Dr. Michael Schröder

Leiter des Forschungsbereichs Internationale Finanzmärkte und Finanzmanagement am ZEW und Professor für Asset Management an der Frankfurt School of Finance & Management



Prof. Dr. Peter Winker

Lehrstuhlinhaber für Statistik und Ökonometrie, Justus-Liebig-Universität Gießen und Research Associate am ZEW

Seminargebühr

Je Seminar **EUR 631,30** (EUR 590,00 zzgl. 7% USt.)

Die Seminare sind einzeln oder zu Sonderkonditionen gemeinsam buchbar. Bitte beachten Sie auch unsere weiteren Rabatte, z.B. für außeruniversitäre öffentliche Forschungseinrichtungen oder Fachhochschulen und Universitäten.

Details finden Sie unter: www.zew.de/konditionen

Die Teilnehmerzahl ist jeweils begrenzt.

Unsere Leistungen für Seminarteilnehmer

- ◉ Umfangreiche Seminarunterlagen
- ◉ Zertifikat als Nachweis der erworbenen Qualifikation
- ◉ Kaffeepausen mit Snacks und Kuchen sowie mit warmen und kalten Getränken
- ◉ Mittagessen mit verschiedenen Hauptgerichten zur Auswahl
- ◉ Kostenloses WLAN
- ◉ Sonderkonditionen in unseren Partnerhotels
- ◉ Reservierung der Hotelunterkunft
- ◉ Tiefgaragenstellplatz im Haus (um Reservierung wird gebeten)

Ihre Ansprechpartnerin



Myriam Riegel

Telefon: +49 (0)621/1235 – 240

Telefax: +49 (0)621/1235 – 224

E-Mail: riegel@zew.de

Das **Zentrum für Europäische Wirtschaftsforschung GmbH (ZEW)** in Mannheim ist eines der führenden deutschen Wirtschaftsforschungsinstitute mit hoher internationaler Reputation. Das Institut bietet neben exzellenter Forschung, auch anspruchsvolle wirtschaftspolitische Beratung an. Zudem stellt das ZEW sein Know-how zur Verfügung, indem es hochwertige Seminare für Fach- und Führungskräfte anbietet.

Die hohe Qualität der ZEW-Seminare wird gewährleistet durch

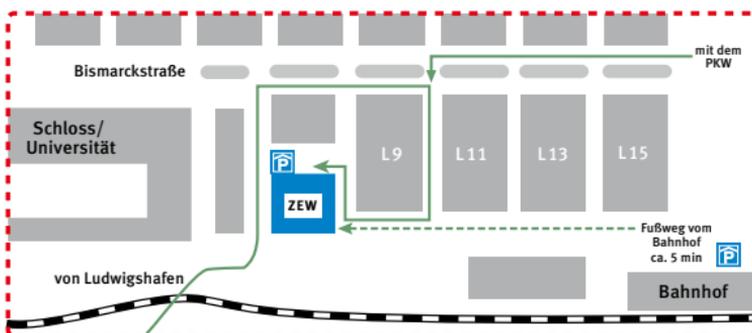
- kleine Teilnehmergruppen
- wissenschaftlich fundierte und praxisnahe Inputs
- Diskussionen, Gruppenarbeiten und „Best Practice“-Beispiele
- das Eingehen auf individuelle Fragestellungen
- erfahrene Referenten, die die Seminarinhalte leicht verständlich und mit Praxisbezug vermitteln
- exzellente technische Ausstattung

Das ZEW-Seminarprogramm beinhaltet neben offenen Seminaren auch Inhouse-Seminare, die speziell auf die Bedürfnisse Ihres Unternehmens oder Ihrer Institution zugeschnitten sind.

Umfangreiche Informationen zu unserem Seminarangebot finden Sie unter:
www.zew.de/weiterbildung



So erreichen Sie uns



www.zew.de/anfahrt

Zentrum für Europäische Wirtschaftsforschung GmbH (ZEW)
Wissenstransfer & Weiterbildung
L 7, 1 · 68161 Mannheim

Telefon: +49 (0)621/1235 – 240

Telefax: +49 (0)621/1235 – 224

E-Mail: weiterbildung@zew.de

Internet: www.zew.de/weiterbildung

