
**ZEITREIHENANALYSE
(Empirische Konjunkturforschung)**

(10 18 110)

SS 2012

Ort: HS 413 **Zeit:** Fr. 10:00 – 11:30 Uhr

Beginn: 20.04.2012

Diese Vorlesung richtet sich an Studierende des Bachelor-Studiengangs "Wirtschaftswissenschaft" und behandelt die wichtigsten Methoden der Beschreibung, Analyse und Prognose ökonomischer Zeitreihen.

Diese Vorlesung wird ergänzt durch die Übung "Praxis der Zeitreihenanalyse" (10 18 144)

⇒ Im SS 2012 wird diese Vorlesung letztmalig angeboten.

GLIEDERUNG

1. Einführung: Anwendungsbereiche der Zeitreihenanalyse
2. Empirische Beschreibung von Zeitreihen
3. Stochastische Prozesse
4. ARIMA-Modelle
5. Prognose

Eine ausführliche Gliederung wird über WueCampus zur Verfügung gestellt.

LITERATUR

Basisliteratur:

BOX, G.E.P./JENKINS, G.M.: Time Series Analysis, Forecasting and Control;
San Francisco: Holden-Day 1976.

FALK, M.: A First Course on Time Series Analysis; Würzburg 2006.
(<http://statistik.mathematik.uni-wuerzburg.de/timeseries/>)

KIRCHGÄSSNER, G./WOLTERS, J.: Einführung in die moderne Zeitreihenanalyse;
München: Vahlen 2006.

KOPF, J.: Arbeitspapiere und Materialien zur Zeitreihenanalyse,
10. Ausgabe; Würzburg 2012.

NEUSSER, K.: Zeitreihenanalyse in den Wirtschaftswissenschaften, 2. Aufl.;
Wiesbaden: Vieweg+Teubner 2009.

SCHLITTGEN, R./STREITBERG, B.: Zeitreihenanalyse, 9. Aufl.;
München/Wien: Oldenbourg 2001.

STIER, W.: Methoden der Zeitreihenanalyse;
Berlin/Heidelberg/New York: Springer 2001,

Weiterführende Literatur:

- CLEMENTS, M.P./HENDRY, D.F.: Forecasting Economic Time Series;
Cambridge: Cambridge University Press 1998.
- FRANSES, Ph.H.: Time Series Models for Business and Economic Forecasting;
Cambridge: Cambridge University Press 1998.
- GRANGER, C.W.J./WATSON, M.W.: Time Series and Spectral Methods in
Econometrics; in: Handbook of Econometrics, Vol. 2,
Amsterdam/New York/Oxford 1984, pp. 979-1022.
- HARVEY, A.C.: Ökonometrische Analyse von Zeitreihen, 2. Aufl.;
München/Wien: Oldenbourg 1994.
- HARVEY, A. C.: Zeitreihenmodelle, 2. Aufl.;
München/Wien: Oldenbourg 1995.
- KAISER, R./MARAVALL, A.: Measuring Business Cycles in Economic Time Series;
New York/Berlin/Heidelberg: Springer 2001.
- LEINER, B.: Grundlagen der Zeitreihenanalyse, 4. Aufl.;
München/Wien: Oldenbourg 1998.
- METZ, R.: Trend, Zyklus und Zufall; Wiesbaden: Steiner 2002.
- OPPENLÄNDER, K.H. (Hrsg.): Konjunkturindikatoren, 2. Aufl.;
München/Wien: Oldenbourg 1996.
- SCHLITTGEN, R.: Angewandte Zeitreihenanalyse;
München/Wien: Oldenbourg 2001.
- SU, V.: Economic Fluctuations and Forecasting;
New York: HarperCollins 1996.
- THOME, : Zeitreihenanalyse; München/Wien: Oldenbourg 2005.
- WEI, W.W.S.: Time Series Analysis; Reading, MA: Addison-Wesley 1990.
- WINKER, P.: Empirische Wirtschaftsforschung und Ökonometrie, 2. Aufl.;
Berlin/Heidelberg/New York: Springer 2007.
- WOLTERS, J.: Methodische Überlegungen zur Analyse ökonomischer Zeitreihen;
in: WOLTERS, J./KUHBIER, P./BUSCHER, H.S.: Die konjunkturelle
Entwicklung in der Bundesrepublik, Frankfurt/New York 1990,
S. 9-41.
- YAFFEE, R.A.: Introduction to Time Series Analysis and Forecasting;
San Diego u.a.O.: Academic Press 2000.