

Hagen, 12. Juli 2016

**Erfahrungsbericht Cagliari Università (Italien), Summer School in Quantitative Economics:**

**„Bayesian methods for macroeconomics, nowcasting, and density forecasting“**

Die *Summer School in Quantitative Economics* der Universität in Cagliari bietet Fachkurse im Bereich der angewandten Makroökonomie, ausgelegt speziell für Wissenschaftler und politische Entscheidungsträger, an.

Ich habe dort zwischen dem 4. und 7. Juli 2016 einen Fachkurs zu bayesianischen vektorautoregressiven Modellen (*Bayesian methods for macroeconomics, nowcasting, and density forecasting*) besucht. Diese haben sich in den letzten Jahren zum Standardmodell für makroökonomische Prognosen entwickelt und werden unter anderem im geldpolitischen Entscheidungsprozess angewendet. Ihr großer Vorteil gegenüber anderen Methoden ist, dass man mit ihrer Hilfe selbst kurze Zeitreihen sowie Modelle mit vielen Einflussfaktoren untersuchen kann. Der Kurs war klar aufgebaut und gut strukturiert. Der erste Tag begann mit einer Einführung in univariate lineare Prognosemodelle. Diese wurden im Laufe des Kurses stets erweitert bis hin zu multivariaten nicht linearen Modellen. Dabei achtete der Kursbetreuer insbesondere auf ein ausgewogenes Maß an Theorie und Praxis. Ferner wurden uns am Ende des Kurses die Vorlesungsfolien als auch die Computercodes zur freien Verfügung überlassen, um die erlernten Kenntnisse nachzuarbeiten und diese auf unsere Forschung anwenden zu können.

Neben den fachlichen Kenntnissen bot die *Summer School in Quantitative Economics* auch eine hervorragende Möglichkeit internationale Wissenschaftler und politische Entscheidungsträger kennen zu lernen. Hier sind insbesondere der Kursbetreuer, *Andrea Carriero* und der Organisator der Summer School, *Alessio Moro* zu nennen. Ersterer war Gastwissenschaftler an der *University of Pennsylvania* und bei der europäischen Zentralbank und ist mittlerweile Professor an der *Queen Mary University of London* und letzterer ist Professor für Volkswirtschaftslehre an der Universität in Cagliari, neben Forschungsaufenthalten bei der *Banco de España* und an der *Bocconi Universität* in Mailand. Beide haben ihre Forschungsschwerpunkte auf die angewandte Makroökonomik gelegt und dazu bereits in mehreren anerkannten Fachzeitschriften veröffentlicht. Ein freundliches erstes Treffen in privater Atmosphäre bot das gemeinsame Abendessen in einem typisch sardischen Restaurant am zweiten Abend meines Aufenthaltes, bei dem sich Betreuer und Kursteilnehmer näher kennen lernen konnten.

Zusammenfassend bot mir die *Summer School in Quantitative Economics* an der Universität in Cagliari die Möglichkeit meine Kenntnisse zu Zeitreihenanalysen zu erweitern und makroökonomische Fragestellungen mit angesehenen Wissenschaftlern in einer kollegialen Atmosphäre zu diskutieren. In diesem Sinne bin ich dankbar für die finanzielle Förderung durch das *DAAD-PROMOS Stipendienprogramm*, dass mir diese Auslandserfahrung ermöglicht wurde.



Martin Kern,

Fakultät für Wirtschaftswissenschaft; Lehrstuhl für Volkswirtschaftslehre, insb. Makroökonomik;  
Prof. Dr. Helmut Wagner