

Erfahrungsbericht zu meinem durch das PROMOS-Stipendium geförderten Fachkursaufenthalt an der Barcelona Graduate School of Economics in Spanien

vorgelegt von Michael Murach, Lehrstuhl für Volkswirtschaftslehre, insbesondere Makroökonomik

Vom 27.06. bis zum 08.07.2016 habe ich an drei Kursen im Rahmen der *Barcelona Graduate School of Economics Summer School* teilgenommen. Die Kurse hatte ich zuvor, mit direktem Bezug zu meinen Forschungsinteressen im Rahmen meiner Dissertation und meiner Forschungstätigkeit am Lehrstuhl, ausgewählt. In der ersten Woche der Summer School habe ich die Kurse “*Empirical Time Series Methods for Macroeconomic Analysis: Introductory*” (Prof. Luca Gambetti) und “*Modeling Non-stationary and Non-linear Time Series*” (Prof. Laura Mayoral & Gabriel Pérez Quirós) belegt. Für die zweite Woche meines Fachkursaufenthalts wählte ich den Kurs “*Empirical Time Series for Macroeconomic Analysis: Advanced*” (ebenfalls Prof. Luca Gambetti). Alle Kurse befassten sich mit dem Themengebiet der angewandten Zeitreihenanalyse. Im Rahmen des ersten Kurses wurden die methodischen Grundlagen vektorautoregressiver Modelle vermittelt. Nachdem das Grundprinzip dieser Methodik vorgestellt worden war, wurde das Grundmodell schrittweise erweitert. So wurden beispielsweise Möglichkeiten diskutiert das den Schätzungen zugrundeliegende Informationsset zu erweitern und wie innerhalb dieses Modelltyps sich änderndem Verhalten der Wirtschaftssubjekte Rechnung getragen werden kann. Der zweite Kurs behandelte im Wesentlichen zwei Themenbereiche: Zunächst ging es um Möglichkeiten der Untersuchung fraktional integrierter Zeitreihen (d.h. Zeitreihen, deren Verlauf weder stationär noch nicht-stationär ist). Hierfür bietet beispielsweise die im Rahmen der ersten beiden Vorlesungstage vorgestellte Methode der fraktionalen Kointegrationsanalyse einen Ansatz, bestehende Gleichgewichtsbeziehungen zwischen den Zeitreihen tiefergehend zu analysieren. Das zweite wesentliche Themengebiet dieses Kurses waren Methoden zur Analyse nichtlinearer Beziehungen zwischen Zeitreihen, die anhand des Praxisbeispiels eines Prognosemodells für das spanische Bruttoinlandsprodukt verdeutlicht wurden. In der zweiten Woche wurden in dem Kurs “*Empirical Time Series for Macroeconomic Analysis: Advanced*” die Kenntnisse des ersten Kurses aus der Vorwoche für die Fälle erweitert, in denen die Information der in dem Modell enthaltenen Variablen nicht ausreicht, um die kausale Struktur innerhalb des Modells gesichert zu identifizieren. Alle Vorlesungen wurden von einstündigen praktischen Übungen am Nachmittag begleitet, in deren Rahmen die Inhalte anhand von Beispielen mit Hilfe der entsprechenden Software (MATLAB) wiederholt und vertieft wurden. Neben den Kursen gab es pro Woche jeweils zweimal ein von der Universität ausgerichtetes Abendprogramm, um die Vernetzung unter den Kursteilnehmern der Summer School zu fördern. Zudem konnte ich von der Möglichkeit Gebrauch machen mit den Dozenten über meine eigene Forschung zu sprechen und in diesem Rahmen Einschätzungen zu methodischen Fragen einzuholen. Insgesamt stellte die Teilnahme an der zweiwöchigen Summer School fachlich eine große Bereicherung für mich dar und eröffnete mir neue Perspektiven. Auf diesem Wege möchte ich mich daher ganz herzlich für die finanzielle Unterstützung durch das PROMOS-Stipendium bedanken.

Hagen, den 08.08.2016

Michael Murach