

Modulbezeichnung		Kurzbezeichnung
DSGE Modelling		12-M-DMM-242-m01
Modulverantwortung		anbietende Einrichtung
Arbeitsgruppe Empirische Wirtschaftsforschung		Wirtschaftswissenschaftliche Fakultät
ECTS	Bewertungsart	zuvor bestandene Module
5	numerische Notenvergabe	--
Moduldauer	Niveau	weitere Voraussetzungen
1 Semester	weiterführend	--
Inhalte		
<p>Der Kurs bietet eine Einführung in die Modellierung von "Dynamic Stochastic General Equilibrium" Modellen (DSGE). Zweck dieser Modelle ist es, die Konjunktur zu beschreiben. Im den ersten Lehrinhalten steht der Haushaltssektor im Vordergrund. Hierbei wird analysiert wie der repräsentative Haushalt seine Konsumplanung, seine Anlageentscheidungen und sein Arbeitsangebotsentscheidungen ausgestaltet. Im zweiten Abschnitt steht der Unternehmenssektor im Vordergrund. Hierbei wird vor allem unternehmerisches Handeln in Form optimaler Produktionspläne analysiert. Im dritten Abschnitt folgt eine Analyse der Notenbank und ihrer Aufgaben im Konjunkturzyklus. Hierbei wird gezeigt wie Notenbankpolitik auf das Verhalten von Haushalten und Unternehmen einwirkt.</p> <p>Anschließend erfolgt eine Einweisung in Dynare/Matlab, da die Modelle typischerweise numerisch ausgewertet werden. Hierbei steht vor allem die Analyse von Impuls-Antwortfunktionen im Vordergrund.</p> <p>Es werden je nach Interesse der Kursteilnehmer auch aktuelle/ spezielle Topics behandelt wie etwa CAPM als Asset-Pricing Model im Rahmen eines repräsentativen Agenten Models, oder aber Geldpolitik in der Eurozone.</p>		
Qualifikationsziele / Kompetenzen		
<p>Der Kurs vermittelt Grundlegende Methodenkompetenzen zum Lösen und Arbeiten mit DSGE Modellen:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Lösen von intertemporalen Optimierungsproblemen (z.Bsp., Konsum Euler Gleichung). • Linearisierungsmethoden (z.Bsp., Taylor Approximationen). • Lösen von linearen Differenzgleichungen mit rationalen Erwartungen (MSV-Solution). • Grundlegende Konzepte der Zeitreihenanalyse, wie Impuls-Antwortfunktionen und Varianz-Dekompositionen. • Einführendes Wissen zu MATLAB/Dynare: Spezifikation, Lösen und Schätzen von DSGE Modellen. <p>Nach dem Besuch der Veranstaltung sind die Studierenden in der Lage DSGE Modelle eigenständig selbst zu entwickeln.</p>		
Lehrveranstaltungen (Art, SWS, Sprache sofern nicht Deutsch)		
V (2) + Ü (2) Veranstaltungssprache: Englisch		
Erfolgsüberprüfung (Art, Umfang, Sprache sofern nicht Deutsch / Turnus sofern nicht semesterweise / Bonusfähigkeit sofern möglich)		
a) Klausur (ca. 60 Min.) oder b) Hausarbeit (ca. 15 S.) Prüfungssprache: Englisch bonusfähig		
Platzvergabe		
--		
weitere Angaben		
--		
Arbeitsaufwand		
150 h		
Lehrturnus		
k. A.		

Bezug zur LPO I

--

Verwendung des Moduls in Studienfächern

Master (1 Hauptfach) Management (2024)

Master (1 Hauptfach) International Economic Policy (2024)