



# STATISTICAL LEARNING UND ÖKONOMETRIE

## BRÜCKEN- SEMINAR

Prof. Dr. Christian Conrad, VWL/Ökonometrie  
Prof. Dr. Enno Mammen, Mathematik/Statistik

**VORBESPRECHUNG**  
Di., 22.10.2019, 15–17 Uhr

**SEMINARTERMINE**  
Dienstags, 15–17 Uhr

**VERANSTALTUNGSORT**  
Bergheimer Str. 58  
ÜR 02.036

**WEITERE INFORMATIONEN**  
im LSF und unter  
[www.marsilius-studien.uni-hd.de](http://www.marsilius-studien.uni-hd.de)

Kontakt: [marsilius-studien@uni-hd.de](mailto:marsilius-studien@uni-hd.de)

### Veranstaltung im Rahmen der MARSILIUS-STUDIEN

In den letzten Jahren haben Methoden aus dem Bereich Statistical Learning zunehmend an Bedeutung für die empirische Wirtschaftsforschung gewonnen. Das Seminar beschäftigt sich mit Anwendungsbeispielen, in denen ökonomische Variablen wie zum Beispiel das BIP-Wachstum oder Inflation über eine oder mehrere Perioden in die Zukunft prognostiziert werden sollen.

Ziel des Seminars wird sein, dass Teams von Studierenden aus unterschiedlichen Disziplinen zunächst jeweils eine Methode ( $k$ -Nearest Neighbors, Ridge Regression, LASSO, Bagging, Random Forests, Boosting und Neural Networks) aus dem Bereich Statistical Learning selbständig erarbeiten und vorstellen. Im zweiten Teil des Seminars sollen die Methoden auf konkrete ökonomische Prognoseprobleme angewendet und evaluiert werden. Hierbei steht der Vergleich mit bestehenden Methoden aus der Ökonometrie (ADL Modelle, Bridge equations und MIDAS) im Vordergrund.