

Inhaltsverzeichnis

Vorwort.....	V
1. Kapitel: Einleitung und Grundlagen.....	1
1.1 Historische Entwicklung der Zeitreihenanalyse.....	3
1.2 Graphische Darstellung ökonomischer Zeitreihen.....	5
1.3 Ergodizität und Stationarität.....	11
1.4 Die Woldsche Zerlegung.....	19
Literaturhinweise.....	21
2. Kapitel: Univariate stationäre Prozesse.....	25
2.1 Autoregressive Prozesse.....	25
2.2 Moving Average Prozesse.....	52
2.3 Gemischte Prozesse.....	60
2.4 Prognosen.....	69
2.5 Zum Zusammenhang zwischen ökonometrischen Modellen und ARMA-Prozessen.....	79
Literaturhinweise.....	80
3. Kapitel: Granger-Kausalität.....	83
3.1 Die Definition der Granger-Kausalität.....	85
3.2 Charakterisierungen kausaler Zusammenhänge in bivariaten Modellen.....	86
3.3 Tests auf Kausalität.....	91
3.4 Anwendungsmöglichkeiten der Kausalitätstests im Rahmen von Modellen mit mehr als zwei Variablen.....	100
3.5 Abschließende Bemerkungen.....	106
Literaturhinweise.....	109
4. Kapitel: Vektor-Autoregressive Prozesse.....	113
4.1 Die Darstellung des Systems.....	115
4.2 Granger-Kausalität.....	122
4.3 Impuls-Antwort Analyse.....	124
4.4 Die Varianzzerlegung.....	128
4.5 Abschließende Bemerkungen.....	133
Literaturhinweise.....	134
5. Kapitel: Nichtstationäre Prozesse.....	137
5.1 Formen der Nichtstationarität.....	137
5.2 Trendelimination.....	142
5.3 Tests auf Nichtstationarität.....	147
5.4 Zerlegung von Zeitreihen.....	162

5.5 Weiterführende Entwicklungen.....	167
5.6 Deterministische versus stochastische Trends in ökonomischen Zeitreihen	171
Literaturhinweise.....	174
6. Kapitel: Kointegration.....	179
6.1 Definition und Eigenschaften kointegrierter Prozesse	183
6.2 Kointegration in Einzelgleichungsmodellen: Repräsentation, Schätzen und Testen	184
6.3 Kointegration in Vektor-Autoregressiven Modellen	196
6.4 Kointegration und ökonomische Theorie	209
Literaturhinweise.....	211
7. Kapitel: Autoregressive bedingte Heteroskedastie.....	215
7.1 ARCH-Modelle	219
7.2 Verallgemeinerte ARCH-Modelle	224
7.3 Schätzen und Testen	231
7.4 ARCH/GARCH-Modelle als Instrument der Finanzmarktanalyse.....	232
Literaturhinweise.....	234
Personenverzeichnis	237
Sachverzeichnis	241