
PRAXIS DER ZEITREIHENANALYSE (10 18 114)

SS 2012

Ort: Datenstation (Raum 30) **Zeit:** Fr. 12:00 - 13:30 Uhr **Beginn:** 20.04.2012

In dieser Lehrveranstaltung werden die Teilnehmer anhand von Beispielen und Übungsaufgaben mit der praktischen Anwendung der Programmsysteme **EViews**, **Statistica**, **Gretl** und **R for Windows** für Probleme der Zeitreihenanalyse vertraut gemacht.

Voraussetzung für die Teilnahme an der Übung ist der Besuch der Vorlesung "Zeitreihenanalyse" (10 18 110).

⇒ Im SS 2012 wird diese Übung letztmalig angeboten.

Anmeldung: bis spätestens Montag, **16.04.2012** über WueCampus.

Aus organisatorischen Gründen ist eine rechtzeitige Anmeldung der Teilnehmer unbedingt erforderlich !

THEMENBEREICHE

1. Datenbeschaffung im Internet
2. Einführung in das Statistik-Programm EViews
3. Einführung das Statistik-Programmsystem Statistica
4. Einführung in das Arbeiten mit R
5. Einführung in das Arbeiten mit Gretl
6. Bearbeitung und Transformation von Zeitreihen
7. ARIMA-Modelle
8. Spektralanalytische Verfahren

LITERATUR

COTRELL, A./LUCCHETTI, R.: Gretl User's Guide, January 2012.

[<http://freefr.dl.sourceforge.net/project/gretl/manual/gretl-guide-a4.pdf>]

KOPF, J.: Aufgaben und Übungen zur "Praxis der Zeitreihenanalyse",
10. Ausgabe; Würzburg 2012.

HATZINGER; R./HORNIK, K./NAGEL, H.: R. Einführung durch angewandte Statistik;
München u.a.O.: Pearson 2011.

HELLBRÜCK, R.: Angewandte Statistik mit R, 2. Aufl.; Wiesbaden: Gabler 2011.

QMS: EViews 7 User Guide; Irvine, Cal.: Quantitative Micro Software 2010.

QMS: EViews 7 Command and Programming Reference;
Irvine, Cal.: Quantitative Micro Software 2010.

SCHMITZ, B.: Einführung in die Zeitreihenanalyse;
Bern/Stuttgart/Toronto: Huber 1989.

StatSoft, Inc.: Electronic Statistics Textbook; Tulsa OK 2010.
[<http://www.statsoft.com/textbook/>]

SU, V.: Economic Fluctuations and Forecasting; New York: HarperCollins 1996.

VOGELVANG, B.: Econometrics. Theory and Applications with EViews.
Harlow u.a.O.: Prentice Hall 2005.

WEIß, Ch.: Datenanalyse und Modellierung mit STATISTICA;
München/Wien: Oldenbourg 2007.

Weitere Literaturangaben: siehe Vorlesung "Zeitreihenanalyse" (10 18 110).