

Errata

in

H. RINNE / K. SPECHT: Zeitreihen — Statistische Modellierung, Schätzung und Prognose;
Verlag Franz Vahlen, München, 2002

Stand: 26. Februar 2005

p. 35 Tab. 2/3

Bei Monatstyp 10 muss es in der Freitag-Spalte 4 statt 5 heißen.

p. 54 letzte Zeile in Fußnote 12

... auf 6958,14 am ... statt ... auf 658,14 am ...

p. 66 in Formel (3.14b)

$1 + w_t := y_t/y_{t-1}$ statt $1 + w_t := y_{t-1}/y_t$

p. 66 1. Zeile unter Formel (3.14b)

... = $\ln(y_t/y_{t-1})$ als ... statt ... = $\ln(y_{t-1}/y_t)$ als ...

p. 78 in der Aufzählung nach der 8. Zeile von oben

- $\lambda < 0$... statt $\lambda \leq 0$...
- ...
- $0 < \lambda < 1$... statt $0 \leq \lambda \leq 1$...
- ...
- $\lambda > 1$... statt $\lambda \geq 1$...

p. 78 in Formel (3.26)

$S(\lambda^*) := \min_{\lambda} \sum_{t=1}^T \left(y_t^{(\lambda)} - \overline{y^{(\lambda)}} \right)^2$ mit $\overline{y^{(\lambda)}} := \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T y_t^{(\lambda)}$.

statt

$S(\lambda^*) := \min_{\lambda} \sum_{t=1}^T \left(y_t^{(\lambda)} - y_t^{(\lambda)} \right)^2$.

p. 131 13. Zeile von unten

... unterhalb der 45°-Linie im statt ... unterhalb der 45° im

p. 133

In Tabelle 4/2 sind in der Kopfzeile die Wörter „Prognose“ und „Realisation“ zu vertauschen.

p. 175 Zähler des Bruchs in Formel (5.60c)

$$\rho_1^3 - \rho_1^2 \rho_3 + \rho_1 \rho_2^2 - 2 \rho_1 \rho_2 + \rho_3 \quad \text{statt} \quad \rho_1^3 - \rho_1^2 \rho_2 + \rho_1 \rho_2^2 - 2 \rho_1 \rho_2 + \rho_1^3$$

p. 257 6. und 7. Zeile unter Abb. 7/1

$\rho_\ell = 0$ für $\ell > m$ versus $H_1: \rho_\ell \neq 0$ für $\ell > m$:

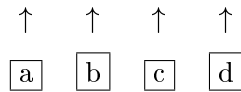
$$\pm 1,96 \sqrt{1 + 2 \hat{\rho}_1^2 + 2 \hat{\rho}_2^2 + \dots + 2 \hat{\rho}_m^2} / \sqrt{n}.$$

statt

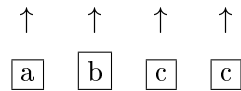
$\rho_m = 0$ für $m > \ell$ versus $H_1: \rho_m \neq 0$ für $m > \ell$:

$$\pm 1,96 \sqrt{1 + 2 \hat{\rho}_1^2 + 2 \hat{\rho}_2^2 + \dots + 2 \hat{\rho}_{\ell-1}^2} / \sqrt{n}.$$

p. 264 in Beispiel 7/2



statt



p. 267 in Formel (7.28.c)

$\dots; \ell \geq 0$ statt $\dots; \ell = 0, \pm 1, \pm 2, \dots$

p. 267 in Formel (7.29)

$\dots; \ell \geq 0$ statt $\dots; \ell = 0, \pm 1, \pm 2, \dots$

p. 268 in Formel (7.30)

| | | |
|---|-------|---|
| $\left. \begin{array}{l} \dots \text{ für } \ell = 1 \\ \dots \text{ für } \ell > 1 \end{array} \right\}$ | statt | $\left. \begin{array}{l} \dots \text{ für } \ell = \pm 1 \\ \dots \text{ für } \ell > 1 \end{array} \right\}$ |
|---|-------|---|

p. 268 3. Zeile unter Formel (7.30)

$\rho_\ell = \rho_1^\ell$ statt $\rho_\ell = \rho_1^{|\ell|}$

p. 276 in Formel (7.53)

$\rho_\ell = \dots$ statt $\boldsymbol{\rho}_\ell = \dots$

p. 277 Zeile über in Formel (7.55d)

$\dots + a_1 \frac{\sigma_{Z^*}}{\sigma_Z} Z_{t-1} + Z_t$ statt $\dots + a_1 \frac{\sigma_Z}{\sigma_{Z^*}} Z_{t-1} + Z_t$

p. 278 2. Zeile von oben

$\dots = 1 + a_1 \frac{\sigma_{Z^*}}{\sigma_Z} L.$ statt $\dots = 1 + a_1 \frac{\sigma_Z}{\sigma_{Z^*}} L.$

p. 279 in Formel (7.58b)

$\dots + \theta_q E(Y_{t-\ell} Z_{t-q}).$ statt $\dots + \theta_p E(Y_{t-\ell} Z_{t-q}).$

p. 297 in Formel (8.12e)

$\dots + \sum_{\tau=1}^t \eta_\tau.$ statt $\dots + \sum_{\tau=1}^t \eta_t.$

p. 298 2. Zeile von oben

$\dots + \sum_{\tau=1}^t \eta_\tau + Z_t,$ statt $\dots + \sum_{\tau=1}^t \eta_t + Z_t,$

p. 303 1. Zeile in Fußnote 5

\dots FRIEDMAN (1957) \dots statt \dots FRIEDMANN (1957)

p. 312 1. Zeile unter Tab. 8/1b

Für $d \geq 0,5$ stellt \dots statt Für $|d| \geq 0,5$ stellt \dots

p. 312 3. Zeile unter Tab. 8/1b

\dots Wert $d < 0,5$ erzielen. Für statt \dots Wert $|d| < 0,5$ erzielen. Für

p. 341 im oberen Teil der Formel (8.79)

\dots für $Z_{t-1} \geq 0$ statt für $Z_{t-1} \geq 0$

p. 363 in Formel (9.19b)

$\dots \frac{\sqrt{T}(\hat{\rho} - 1)}{\hat{\sigma}_Z} \sqrt{\frac{1}{T} \sum_{t=1}^T Y_{t-1}^2}$ statt $\dots \frac{(\hat{\rho} - 1)}{\hat{\sigma}_Z} \sqrt{\frac{1}{T} \sum_{t=1}^T Y_{t-1}^2}$

p. 369 7. Zeile im zweiten Absatz

\dots irgendein $1 \leq \ell \leq p^* - 1$ abgelehnt \dots statt \dots irgendein $\ell \geq p^* - 1$ abgelehnt

\dots

p. 371 3. Zeile von oben

$$\dots \gamma Y_{t-1} + Z_t \text{ bzw. } \dots \gamma Y_{t-1} + \sum_{j=1}^{p-1} c_j \nabla Y_{t-j} + Z_t$$

statt

$$\dots \gamma Y_{t-1} Z_t \text{ bzw. } \dots \gamma Y_{t-1} \sum_{j=1}^{p-1} c_j \nabla Y_{t-j} + Z_t$$

p. 374 3. Zeile von oben

... eines Instrumentalvariablenschätzers für ... statt ... eines Instrumentalvariablenschätzers für

p. 375 9. Zeile von oben

... ein oder mehrere ... statt ... ein der mehrere

p. 376 Vorletzte Zeile in Tab. 9/4 in der AKR-Spalte

Verlauf für $\ell > q$ wie im statt Verlauf für $\ell > p$ wie im

p. 376 Vorletzte Zeile in Tab. 9/4 in der PAKR-Spalte

Verlauf für $\ell > p$ wie im statt Verlauf für $\ell > q$ wie im

p. 380 Formel (9,37b)

$$Y_t = \sum_{i=1}^p \phi_i Y_{t-i} + \dots \text{ statt } Y_t = \sum_{i=1}^p \phi_i Y_{t-1} + \dots$$

p. 388 3. Zeile von unten

... im Kap. 12 wird ... statt ... im Kap. 9 wird ...

p. 392

Nach der 11. Zeile von oben ist hinter ϕ_p , der Zeilenumbruch überflüssig.

p. 392 In der Zeile unter Formel (10.3b)

... YULE-WALKER-Gleichungen (7.52.a) für ... statt

... YULE-WALKER-Gleichungen (7,52.a) für ...

p. 394 9. Zeile von oben

... oder $\hat{\theta}_1 = -1, \dots$ statt ... oder $\hat{\theta}_2 = -1, \dots$

p. 402 in Formel (10.13a)

... $(2 \cdot \mathbf{1}' \Sigma^{-1} \dots$ statt ... $(2 \cdot \mathbf{1} \Sigma^{-1} \dots$

p. 404 in Formel (10.17a)

$$\dots \phi_1(Y_{t-1} - \mu_Y) \dots \text{ statt } \dots \phi_1(Y_t - \mu_Y) \dots$$

p. 409 in Formel (10.22d)

$$0 \leq D \leq 4mT. \quad \text{statt} \quad 0 \leq D \leq 4mT^2.$$

p. 412 in Formel (10.26c)

$$AIC_\sigma := -\frac{2}{T} AIC_\ell. \quad \text{statt} \quad AIC_\sigma := -\frac{T}{2} AIC_\ell.$$

p. 413 in Formel (10.27c)

$$SBC_\sigma := -\frac{2}{T} SBC_\ell. \quad \text{statt} \quad SBC_\sigma := -\frac{T}{2} SBC_\ell.$$

p. 413 in Formel (10.28c)

$$HQC_\sigma := -\frac{2}{T} HQC_\ell. \quad \text{statt} \quad HQC_\sigma := -\frac{T}{2} HQC_\ell.$$

p. 419 in Formel (11.6)

$$\dots = \frac{\sum_{i=0}^{k-1} \psi_i \psi_{h+k}}{\dots}, \dots \quad \text{statt} \quad \dots = \frac{\sum_{i=0}^{h-1} \psi_i \psi_{h+k}}{\dots}, \dots$$

p. 429 in Formel (11.25b)

$$\dots = \kappa + \sum_{i=1}^p \alpha_i Z_{\tau-i}^2. \quad \text{statt} \quad \dots = \kappa + \sum_{i=1}^p \alpha_i Z_{\tau-1-i}^2.$$

p. 429 in Formel (11.25c)

$$\dots = \kappa + \sum_{i=1}^p \alpha_i E(Z_{\tau+h-i}^2) = \kappa + \sum_{i=1}^p \alpha_i \hat{H}_t(h-i). \quad \text{statt}$$
$$\dots = \kappa + \sum_{i=1}^p \alpha_i E(Z_{\tau+h-1-i}^2) = \kappa + \sum_{i=1}^p \alpha_i \hat{H}_t(h-1-i).$$

p. 445 in Tab. 12/4, 2. Spalte, 2. Zeile

2755 statt 22755

p. 457 in Tab. 13/1

Bei der Kombination $r \ s \ d = 1 \ 2 \ d$ ist in der äußerst rechten Spalte für ν_j zu ergänzen: ω_0 für $j = d$.

p. 465 4. Zeile von unten

... zur MA-Darstellung statt ... zur AR-Darstellung

p. 468 in Formel (13.18b)

$$Y_t = \sum_{j=0}^{\infty} \nu_j L^j X_t \dots \quad \text{statt} \quad Y_t = \sum_{j=0}^{\infty} \nu_j L^j X_t \dots$$

p. 469 Zeile vor Formel (13.20d)

... noch $\omega(L) = 1$, so ... statt ... noch $\omega(L) = 0$, so ...

p. 469 5. Zeile von unten

Die von BOX/JENKINS (1976, chapter 11) ... statt

Die von BOX/JENKINS(1976, chapter 11) ...

p. 482 4. Zeile von oben

... gemäß (13.28e) als statt ... gemäß (13.28c) als

p. 483 Mitte

$$\hat{u}(L) = \dots \quad \text{statt} \quad \hat{u}(\ell) = \dots$$

p. 493 Mitte

außerhalb des Einheitskreises ... statt außerhalb des Einheitskreisen ...

p. 508 12. Zeile von oben

$$\tilde{\mathbf{y}}_t = \Phi_1 \tilde{\mathbf{y}}_{t-1} + \mathbf{S} \mathbf{z}_t^{(n)} + \Theta_1 \mathbf{S} \mathbf{z}_{t-1}^{(n)}. \quad \text{statt}$$

$$\tilde{\mathbf{y}}_t = \Phi_1 \tilde{\mathbf{y}}_{t-1} + \mathbf{S} \mathbf{z}_t^{(n)} + \Theta_1 \mathbf{S} \mathbf{z}_t^{(n)}.$$

p. 512 7. Zeile von oben

... mit dem skalaren Operatorpolynom statt ... und dem skalaren Operatorpolynom

p. 512 4. Zeile von unten

... und $\Phi_1^*(L) = \dots$ statt ... und $\Phi_p^*(L) = \dots$

p. 512 2. Zeile von unten

$$\tilde{\mathbf{y}}_t = \Phi_1^*(L) \mathbf{Z}_t = \dots \quad \text{statt} \quad \tilde{\mathbf{y}}_t = \Phi_1^*(L) \mathbf{Z}_t = \dots$$

p. 518 8. Zeile von oben

bei der j -ten exogenen Variablen ... bei der i -ten endogestatt

bei der i -ten exogenen Variablen ... bei der j -ten endoge-

p. 521 8. Zeile von unten

... für strenge Exogenität ... statt ... für starke Exogenität ...

p. 544 7. Zeile von oben

$Y_{1t} \sim I(1)$ statt $Y_{2t} \sim I(1)$

p. 546 1. Zeile von oben

... der Folge der Langfristzinssätze ... statt ... der Folge der Kurzfristzinssätze