

Session

TSA02: Zeitreihenanalyse

Zeit: Dienstag, 23.03.2010: 14:40 - 15:40

Ort: HG II - HS 6

Chair der Sitzung: Jens-Peter Kreiss

Applications

Präsentationen

A fluctuation test for constant correlation

Dominik Wied¹, Matthias Arnold¹, Herold Dehling²

¹TU Dortmund, Fakultät Statistik, Deutschland; ²Ruhr-Universität Bochum, Fakultät für Mathematik, Deutschland

Identification in a Structural Fractionally Integrated System of Aggregate Price Level and Output

Rolf Tschernig, Enzo Weber, Roland Weigand

Universität Regensburg, Deutschland

Generalized Linear Dynamic Factor Models - An Approach via Singular Autoregressions

Brian D. O. Anderson¹, Manfred Deistler², Alexander Filler², Weitian Chen¹

¹Research School of Information Sciences and Engineering, Australian National University Canberra, Australia; ²Department of Mathematical Methods in Economics, Vienna University of Technology Vienna, Austria,