

Kleine Projekte

(1) Wählen sie 10 Reihen, wenden sie ein automatisches Prognoseverfahren aus und berechnen sie für die letzten Beobachtungen Prognosewerte. Bewerten sie mittels RMSE.

(1.a) A1, die letzten 4 Jahre.

(1.b) B1, die letzten 8 Quartale.

(1.c) C1, die letzten 12 Monate.

(2) Wählen sie in Abstimmung mit (1) 3+3+4 Reihen, modellieren sie univariat mit einem (saisonalen) ARIMA und berechnen sie passend zu (1) die Prognosen. Bewerten sie ebenfalls mit RSME. Die Ergebnisse aus (1) und (2) sollen direkt vergleichbar sein. (Die Aufgabe wird auf 3 Gruppen aufgeteilt.)

(3) Wählen sie das X-12 bzw. TRAMO-SEATS Verfahren zur Saisonbereinigung bzw. Modellierung. Vergleichen sie im Falle von C1 mit dem Ergebnis aus (2).

(3.a) C1, Monatsdaten.

(3.b) D1, Wochendaten.

(3.c) E1, Tagesdaten.

Achten sie bei D1 und E1 darauf, dass sie US amerikanische Reihen wählen, damit der Kalender in den Daten mit dem Kalender in EViews übereinstimmt.

(4) Wählen sie 2 oder mehrere passende Reihen, die in einem Zusammenhang stehen, und verwenden sie zur Prognose entweder eine VAR, oder eine VEC mit Kointegration. Versuchen sie ihr Studiendesign mit dem der anderen Kollegen abzustimmen, damit die RMSE direkt vergleichbar sind.