Mathematisches Institut
Universität zu Köln
Prof. Dr. Josef Steinebach

50 931 Köln, den 12.10.2005
Weyertal 86-90
Tel. : 0221-470 2891 (Sekr. 2892)
Fax : 0221-470 6073
E-mail: jost@math.uni-koeln.de

Statistik nichtlinearer stochastischer Prozesse

Seminar, WS 2005/06

Literatur

Aue, A., Berkes, I., Horváth, L. (2005) Strong approximation for the sums of squares of augmented GARCH sequences. Preprint, University of Utah, Salt Lake City, 26 p.

Berkes, I., Horváth, L., Kokoszka, P. (2003) GARCH processes: structure and estimation. *Bernoulli* **9,** 201–227.

Nicholls, D.F., Quinn, B.G. (1982) *Random Coefficient Autoregressive Models: An Introduction.* Lecture Notes in Statistics, Springer-Verlag, New York.

Vorträge

1. Hendrik Alexander **Mertens:** *GARCH–Prozesse: Struktur und Schätzung.*
[Berkes–Horváth–Kokoszka: S. 201–227]

2. Dominik **Reinhold:** *Erweiterte GARCH–Prozesse: Starke Approximationen.*
[Aue–Berkes–Horváth: S. 1–26]

3. Thomas **Ucsnay:** *RCA-Zeitreihen: Stationarität und Stabilität.*
[Nicholls–Quinn: S. 1–39]

Ort und Zeit: **Mo, 12.15–14.00 Uhr**, Seminarraum 1 des Mathematischen Instituts

Beginn: **24. Oktober 2005**