

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung und Überblick	1
2	Das Problem	3
2.1	Modell und Notation	3
2.2	Konsequenzen korrelierter Störgrößen für <i>OLS</i> -gestützte Inferenz	9
3	Bisherige Ergebnisse zur Kovarianzschätzung	16
3.1	Kovarianzschätzung bei reiner Heteroskedastie	16
3.2	Durchschnittsschätzung der Kovarianzmatrix	26
3.3	Durchschnittsschätzung kombiniert mit Kernen	37
3.4	Komponentenweise Schätzung der Kovarianzmatrix	45
4	Kovarianzschätzung bei trendbehafteten Regressoren	52
4.1	Durchschnittsschätzung und Trend	52
4.1.1	Univariates Regressionsmodell	52
4.1.2	Multivariates Regressionsmodell	63
4.2	Komponentenweise Schätzung und Trend	74
4.2.1	Univariates Regressionsmodell	74
4.2.2	Multivariates Regressionsmodell	81
5	Illustrationen	87
5.1	Kovarianzschätzungen im Vergleich	87
5.2	Empirische Verteilung der geschätzten <i>t</i> -Teststatistik	92
	Symbolverzeichnis	96
	Literatur	97