

## Inhalt

1.	Nicht-rekursive Filter	1
1.1.	Grundbegriffe der Filtertheorie	1
1.2.	Konstruktion von FIR-Filtern durch "windowing"	3
1.2.1.	Ein Simulationsbeispiel	10
1.2.2.	Ein praktisches Beispiel	15
1.2.3.	Ein Vergleich mit einfachen gleitenden Durchschnitten	16
1.3.	Optimale FIR-Filter	20
2.	Rekursive Filter	24
2.1.	Einfache rekursive Filter	24
2.2.	Optimale rekursive Filter	28
2.3.	Der Kerbenfilter	29
3.	Die Verwendung von rekursiven Filtern zur Lösung praktischer Probleme der Zeitreihenanalyse	33
3.1.	Zum Problem der "long-swings"	33
3.2.	Grundsätzliche Probleme der Saisonbereinigung ökonomischer Zeitreihen	38
3.2.1.	Vorbemerkungen	38
3.2.2.	Zum Vergleich von Saisonbereinigungsverfahren	40
3.2.3.	Verknüpfung von Zeitbereichsanalyse und Frequenzbereichsanalyse?	46
3.3.	Saisonbereinigung und rekursive Filter	69
3.4.	Ein neues Verfahren zur Saisonbereinigung ökonomischer Zeitreihen	78
3.5.	Ein neues Verfahren zur Schätzung einer "glatten Reihe"	81
3.6.	Rekursive Filter und Zeitreihenprognose	83
4.	Anhang	87