

Modell  $y = f(x, a) + u$

$x$  erklärende Größe, unabhängige Variable  
exogene Größe, Input, Ursache, Edukt

$y$  erklärte Gr., abhängige Var.  
endogene Gr., Output, Wirkung, Produkt

$a$  Parameter

$u$  Störung

$x, a, (y)$  : Vektoren

$x_k, y_k$  : Stichproben

$\rightarrow \tilde{a}$  aus Schätzungen

KQ

kleinste (Fehler)quadrate

ML

maximum Likelihood

$y = f(x, \tilde{a})$  Struktur

damit Interpolation, Extrapolation,  
Prognose

$x_k, y_k$  : Zeitreihen, meist äquidistant

||

$t_k$

$$t_k = t_{k-1} + \Delta t$$

const.

$$y_t = f(t, a) + u_t$$

z.B.

$$f(t, a) = \alpha + \beta t$$

$$(+ \gamma t^2 + \dots)$$

$$a = \begin{Bmatrix} \alpha \\ \beta \\ \vdots \\ \gamma \end{Bmatrix}$$