

readme.txt

Daniel Maul, Martin Fischer und Dirk Schiereck, „Spekulation am Terminmarkt und die Preisentwicklung von Agrarrohstoffen am Kassamarkt: Eine Zeitreihenanalyse der CFTC Berichte für Weizen, Mais und Sojabohnen“, Jahrbücher für Nationalökonomie und Statistik, forthcoming.

COT-report.txt: Zeitreihen des Commitments of Traders report.

DCOT-report.txt: Zeitreihen des Disaggregated Commitments of Traders report.

Daily-report.txt: Zeitreihen der täglichen Daten.

Dokumentation.txt: Erläuterung (Aufbau und Quellen) der COT-report, DCOT-report und Daily-report Zeitreihen.

Stata code COT-report.txt: Aufbereitung und Schätzung der COT-Zeitreihen in Stata

Stata code DCOT-report.txt: Aufbereitung und Schätzung der DCOT-Zeitreihen in Stata

Stata code daily-report.txt: Aufbereitung und Schätzung der daily-Zeitreihen in Stata