

Inhaltsverzeichnis

| | |
|---|------------|
| Abkürzungsverzeichnis | iii |
| Symbolverzeichnis | v |
| Abbildungsverzeichnis | ix |
| Tabellenverzeichnis | xv |
| 1 Einführung und Motivation | 1 |
| 2 Der GARCH(p, q)–Prozeß | 7 |
| 2.1 Definition und Eigenschaften | 8 |
| 2.2 Parameterschätzung | 28 |
| 2.3 Spezialfall: Der <i>GARCH</i> (1, 1)–Prozeß | 37 |
| 3 Erweiterungen | 45 |
| 3.1 Nichtlineare <i>GARCH</i> –Prozesse | 45 |
| 3.2 Exponentielle <i>GARCH</i> –Prozesse | 48 |
| 3.3 Sonstige Prozesse | 52 |

| | | |
|----------|--|------------|
| 4 | Der minimale mittlere quadratische Fehler für die bedingte Varianz bei Fehlspezifikation | 59 |
| 5 | Die bedingte Varianz bei Fehlspezifikation | 83 |
| 5.1 | Simulationsdesign | 84 |
| 5.2 | Der mittlere quadratische Fehler für die bedingte Varianz bei Fehlspezifikation von $GARCH(p, q)$ -Prozessen | 91 |
| 5.3 | Die optimalen Parameter bei Fehlspezifikation durch einen $GARCH(1, 1)$ -Prozeß | 99 |
| 5.4 | Die geschätzte Parametersumme bei der Fehlspezifikation von $GARCH(p, q)$ -Prozessen | 103 |
| 5.5 | Fehlspezifikation von $EGARCH$ -Prozessen | 108 |
| 6 | Empirisches Beispiel | 127 |
| 6.1 | Datenbeschreibung | 130 |
| 6.2 | Anpassen von $(E)GARCH(p, q)$ -Prozessen | 136 |
| 7 | Zusammenfassung und Ausblick | 145 |
| | Anhang | 149 |
| | Literaturverzeichnis | 165 |