

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(1, 1)</i> -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