

# INHALTSVERZEICHNIS

	Seite	
§ 0	Einleitung	3
§ 1	Stochastische Prozesse	13
§ 2	Martingale und stochastische Integrale	18
§ 3	Punktprozesse	30
§ 4	Der Kompensator eines Punktprozesses	36
§ 5	Konvergenz in der Verteilung von Martingalen	64
§ 6	Martingale-Schätzer	76
§ 7	Ein statistisches Modell für Punktprozesse	85
§ 8	M-Schätzer für das statistische Modell aus §7	91
§ 9	Absolute Stetigkeit, Likelihoodquotient	106
§10	Das multiplikative Intensitätsmodell, Definition und Beispiele	126
§11	Das Schätzen der integrierten Intensitätsfunktion im multiplikativen Intensitätsmodell	136
§12	Das Schätzen der Intensitätsfunktion im multiplikativen Intensitätsmodell	167
§13	Wahl der Gewichtsfunktion und des Fensters beim Schätzen der Intensitätsfunktion	191
§14	Hypothesenprüfung beim multiplikativen Intensitätsmodell, eine Stichprobe	220
§15	Hypothesenprüfung für den Fall $k = 2$	230
§16	Hypothesenprüfung für den Fall $k \geq 2$	246
§17	Tests vom Kolmogorov-Smirnov Typ	273
§18	Das Cox'sche Regressionsmodell	286
§19	Das Regressionsmodell von Aalen	304
§20	Transformation in einen Poisson-Prozeß	311
§21	Maximum-Likelihood Schätzung in einem parametrischen multiplikativen Intensitätsmodell	324
§22	Einige wirtschaftswissenschaftliche Anwendungsmöglichkeiten	343
	Literaturverzeichnis	390
	Verzeichnis der Definitionen	403
	Verzeichnis der Notationen	408