

# Inhaltsverzeichnis

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

<b>4</b>	<b>Der minimale mittlere quadratische Fehler für die bedingte Varianz bei Fehlspezifikation</b>	<b>59</b>
<b>5</b>	<b>Die bedingte Varianz bei Fehlspezifikation</b>	<b>83</b>
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
<b>6</b>	<b>Empirisches Beispiel</b>	<b>127</b>
6.1	Datenbeschreibung . . . . .	130
6.2	Anpassen von $(E)GARCH(p, q)$ -Prozessen . . . . .	136
<b>7</b>	<b>Zusammenfassung und Ausblick</b>	<b>145</b>
	<b>Anhang</b>	<b>149</b>
	<b>Literaturverzeichnis</b>	<b>165</b>