

Inhalt

Vorwort	7
1. Einleitung	9
2. Struktur von Kassenhaltungsmodellen	11
2.1 Kostenkriterien	12
2.2 Zahlungsprozeß	15
2.3 Kassenhaltungssystem	19
3. Übersicht über die bisher erzielten Ergebnisse	22
3.1 Modelle mit deterministischem Zahlungsprozeß	23
3.1.1 <i>Einperiodenmodelle</i>	23
3.1.2 <i>Mehrperiodenmodelle</i>	25
3.2 Modelle mit rein stochastischem Zahlungsprozeß	28
3.2.1 <i>Einperiodenmodelle</i>	28
3.2.2 <i>Mehrperiodenmodelle</i>	36
4. Methoden zur Analyse und Prognose von Zahlungsprozessen und Verfahren zur Optimierung der Kassenhaltung	47
4.1 Analyse des Sparprozesses 1962-64	49
4.2 Lineare Zeitreihenmodelle	59
4.2.1 <i>Allgemeines univariablen Zeitreihenmodell</i>	59
4.2.2 <i>Spezielle Zeitreihenmodelle (p,d,q)</i>	61
4.2.3 <i>Saisonale Zeitreihenmodelle (P, D, Q S p, d, q)</i>	62
4.2.4 <i>Identifikation, Parameterschätzung, Residualanalyse, Prognose</i>	63
4.2.5 <i>Quadratminimale Prognoseansätze</i>	65
4.3 Prognose des Sparprozesses 1969	69
4.4 Dynamische Programmierung	84
4.4.1 <i>(N,S,L) γ-KM mit nicht-autokorreliertem Zahlungsprozess</i>	85
4.4.2 <i>(N,S,L)-KM mit autokorreliertem Zahlungsprozeß</i>	86
4.4.3 <i>Separable Optimierung</i>	88
5. Die numerische Lösung des Kassenhaltungsproblems eines Kreditinstituts	94
5.1 Aufstellung des Kassenhaltungsmodells	95
5.2 Statistische Analyse des Sparprozesses	97

5.3	Bestimmung einer kostenoptimalen Transferpolitik und Ermittlung des zugehörigen Sicherheitsbestandes	116
5.4.	Sensibilitätsanalysen	120
6.	Schlußbemerkung	121
	Literaturverzeichnis	122
	Register	128
	Anhang	132
	Symbolliste	132
	Diagramm zu den Pearson-Typen	134
	Kolmogorov-Smirnov-Anpassungstest	135
	Verteilung von Wochentagen auf Monate des Jahres 1969	136
	Flußdiagramm zur dynamischen Optimierung der Kassenhaltung	137
	ALGOL-Quellenprogramm zur dynamischen Optimierung der Kassenhaltung	138
	Sparsaldo 1962-64	140
	Sparsaldo (bar) 1969	142