

# Inhaltsverzeichnis

<b>Abbildungsverzeichnis</b>	<b>xiii</b>
<b>1 Einleitung</b>	<b>1</b>
<b>2 Langes Gedächtnis in Finanzmarktdaten</b>	<b>7</b>
2.1 Definition von langem Gedächtnis . . . . .	14
2.2 Modellierung von langem Gedächtnis . . . . .	17
2.2.1 ARFIMA-Prozesse . . . . .	17
2.2.2 Die fraktionale Brownsche Bewegung . . . . .	21
2.3 Scheinbar langes Gedächtnis . . . . .	25
2.4 Strukturbruchmodelle . . . . .	28
2.4.1 Strukturbrüche im Mittelwert . . . . .	28
2.4.2 Strukturbrüche in der bedingten Varianz . . . . .	32
<b>3 Intermittierendes deterministisches Chaos</b>	<b>37</b>
3.1 Definition von deterministischem Chaos . . . . .	38
3.2 Definition von intermittierendem deterministischem Chaos . . . . .	43
3.3 Die invariante Dichte . . . . .	51
3.4 Reguläre Funktionen . . . . .	55
3.4.1 Polynomiale Funktionen . . . . .	56
3.4.2 Logarithmische Funktionen . . . . .	59
3.5 Cusp Funktionen . . . . .	63
3.5.1 Die achsensymmetrische Cusp Funktion . . . . .	63
3.5.2 Punktsymmetrische Cusp Funktionen . . . . .	66
<b>4 Simulation von intermittierendem deterministischem Chaos</b>	<b>77</b>
<b>5 Zusammenfassung und Ausblick</b>	<b>87</b>
<b>Literatur</b>	<b>91</b>