

# Abbildungsverzeichnis

Abb. 1.1	Vorhersagefehler —— 3
Abb. 2.1	Einfache und multiple lineare Regression —— 8
Abb. 2.2	Zusammensetzung der Abweichungen —— 32
Abb. 2.3	Wirkung von Ausreißern —— 43
Abb. 2.4	Linearer vs. nichtlinearer Zusammenhang —— 49
Abb. 2.5	Nichtlinearer Zusammenhang und daraus resultierende Transformationen —— 50
Abb. 2.6	Heteroskedastizität —— 60
Abb. 2.7	Auswirkung von Autokorrelation —— 69
Abb. 2.8	Normalverteilung —— 81
Abb. 2.9	Quantil-Quantil-Plot —— 82
Abb. 3.1	Mittelwertplots —— 98
Abb. 3.2	Pooled Model —— 101
Abb. 3.3	De-Meaning —— 102
Abb. 4.1	Transformation in der logistischen Regression —— 121
Abb. 4.2	Linkfunktionen —— 122
Abb. 4.3	Mittlere marginale Effekte mit Konfidenzband —— 141
Abb. 4.4	ROC-Kurve mit AUC —— 162
Abb. 5.1	Partitionsplot —— 168
Abb. 5.2	Partitionsplot Klassifikationsbaum, LDA, QDA —— 176
Abb. 6.1	Exemplarische Daten für eine Hauptkomponentenanalyse —— 203
Abb. 6.2	Erste Hauptkomponente —— 204
Abb. 6.3	Zweite Hauptkomponente —— 205
Abb. 6.4	Biplot der Variablen —— 206
Abb. 6.5	Rotation des Koordinatensystems —— 207
Abb. 6.6	Scree-Plot —— 212
Abb. 7.1	Weißes Rauschen —— 223
Abb. 7.2	Random Walk —— 227
Abb. 7.3	Differenzbildung Random Walk —— 228
Abb. 7.4	Stochastischer und deterministischer Trend —— 232
Abb. 7.5	Simulierter AR(1)-Prozess —— 236
Abb. 7.6	Korrelogramme des simulierten AR(1)-Prozesses —— 237
Abb. 7.7	Simulierte MA(1)-Prozesse —— 239
Abb. 7.8	Korrelogramme der simulierten MA(1)-Prozesse —— 239
Abb. 7.9	Volatilitätscluster —— 253
Abb. 7.10	Beispiele für ARCH-Prozesse —— 254
Abb. 7.11	ARCH-Effekt —— 255
Abb. 7.12	Beispiele für GARCH-Prozesse —— 257
Abb. 8.1	Schätz- und Ereignisfenster —— 273

