

# 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	Partionsplot — 168
Abb. 5.2	Partionsplot 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

