

Inhaltsverzeichnis

Einleitung	5
1 Vorbereitungen	9
1.1 Statistische Grundlagen	9
1.2 Submartingale	14
1.3 Dichteprozess	18
1.4 Zeittransformation	19
2 Zeittransformation	23
2.1 Eigenschaften der Intensitätsfunktion	24
2.2 Konstruktion eines Punktprozesses	27
3 Poisson-Prozess mit veränderlicher Intensität	31
3.1 Poisson Prozess — ein einführendes Beispiel	31
3.1.1 Maximum-Likelihood-Verfahren	32
3.1.2 Hypothesenprüfung	34
3.2 Eigenschaften des Prozesses	34
3.2.1 Konstruktion	34
3.2.2 Bestimmung der Dichte	39
3.2.3 Eigenschaften der Verweilzeiten	42
3.3 Statistische Resultate	44
3.3.1 Statistische Modelle	44
3.3.2 Punktschätzer für den unbekanntem Parameter	50
3.3.3 Hypothesenprüfung	58
4 Cox-Prozesse	61
4.1 Eigenschaften des Prozesses	61
4.2 Statistische Resultate	63
4.2.1 Statistische Modelle, Suffizienz, Vollständigkeit	64
4.2.2 Maximum-Likelihood-Verfahren	69
4.2.3 Schätzung von Kenngrößen der Verteilung	75

5	Cox-Prozess mit veränderlicher Intensität	81
5.1	Eigenschaften des Prozesses	81
5.1.1	Konstruktion	81
5.1.2	Bestimmung der Dichte	85
5.1.3	Eigenschaften der Verweilzeiten	87
5.2	Statistische Resultate	88
5.2.1	Statistische Modelle	88
5.2.2	Maximum-Likelihood-Verfahren	98
5.2.3	Schätzer für Kenngrößen der Verteilung	104
	Literatur	110