

- Dow Jones Industrial, DJ STOXX, DJ STOXX 400 Health & Care, DJ STOXX 400 Oil & Gas, DJ STOXX 400 Financial, DJ STOXX 400 Industrial Goods, Dow Jones Industrial futures,
- S&P 500, S&P 500 Industrial, S&P 500 Info Technology, S&P 500 Utilities, S&P 500 Energy, S&P 500 Financial, S&P 500 Gold, S&P 500 futures,
- NASDAQ, NASDAQ Computers, NASDAQ Biotechnology, NASDAQ futures,
- Swiss market index, NIKKEI 225 index, TSE Topics,
- Wechselkurse USD zu EURO, UK Pound, Swiss Frank, Chinese Yuan, Japanese Yen, Canadian Dollar,
- Der Öl- und Goldpreis,
- Die Geldmarktzinssätze und die Government bond yields

Als Zielvariable ist Stand des DJ bei Börsenschluss jedes Tages definiert.

2.2.3 Die Modellierung

2.2.3.1 Das Lernen und Validieren

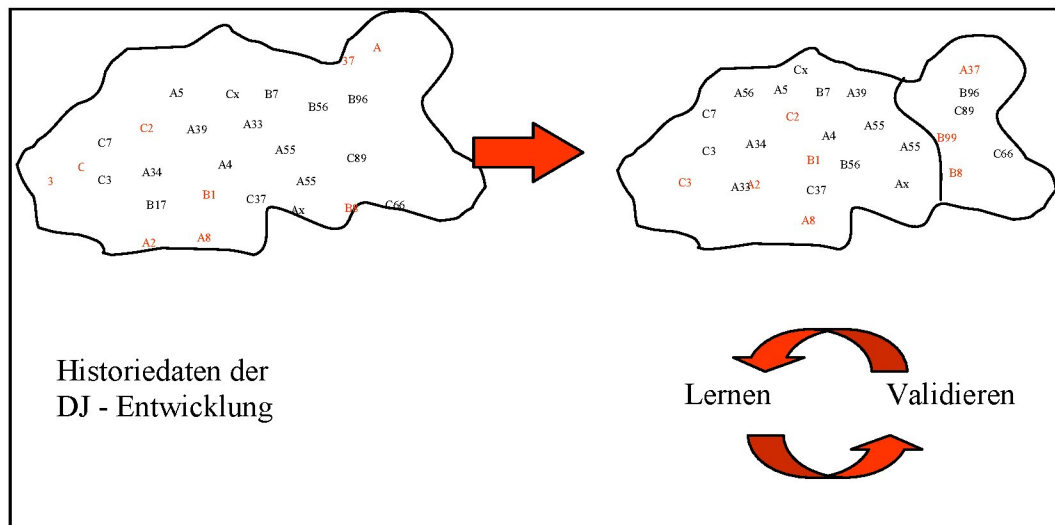


Abb.2. Lernen und Validieren

Die Ausgangsbasis für den Modellerstellungsprozess sind die vorhandenen Historiedaten der DJ – Entwicklung. In diesen sind für jedes definierte Szenario gemäss der Businessfrage (vgl. 2.2.1) die gesuchten Fälle bekannt. Von den Ausgangsdaten wird eine Teilmenge für den Lernprozess des Modells verwendet. In dieser Teilmenge werden die gesuchten Fälle (entsprechend der Definition der