

Tabelle1

Korrelationstabellen zur Lektion 1 des Kurses "Analyse + Modellierung"						
Wöchentliche Änderung des S&P500 in (%)						
	S&P500	Sentiment	Sentiment	Sent. Änder.	Sent. Änder.	
Prognose	Autokorr	Cons. Inc.	Market Vane	Cons. Inc.	Market Vane	
1 Woche	-0,084	-0,017	0,034	0,045	-0,048	
2 Wochen	0,028	-0,039	0,055	-0,018	0,062	
3 Wochen	0,003	-0,026	0,029	-0,058	-0,087	
4 Wochen	-0,019	-0,006	0,067	-0,038	-0,026	
Wöchentliche Änderung des S&P500 in (%)						
	S&P500	NYSE	CBOE	CBOE	CBOE	CBOE
Prognose	Autokorr	Vol. Änder.	Put Änder.	Call Änder.	Put+Call Änd	Put/Call
1 Woche	-0,084	0,091	-0,031	0,009	0,007	0
2 Wochen	0,028	0,067	0,077	0,074	0,077	0,004
3 Wochen	0,003	0,009	0	0,029	0,023	0,016
4 Wochen	-0,019	-0,019	0	-0,02	-0,014	0,019
Wöchentliche Änderung des S&P500 in (%)						
Änderung der Korrelationskoeffizienten über die Zeit						
Prognosezeit 1 Woche (d.h. Untersucht wird die Korrelation mit der Änderung des S&P500 in der Folgewoche)						
bis Juli2002	S&P 500 Änd	NYSE				
	Autokorr	Vol. Änder.				
ca. 6 Jahre	-0,136	0,152				
ca. 8 Jahre	-0,134	0,133				
ca. 10 Jahre	-0,14	0,125				
ca. 12 Jahre	-0,127	0,118				
ca. 14 Jahre	-0,134	0,106				
ca. 16 Jahre	-0,088	0,104				
ca. 18 Jahre	-0,101	0,099				