

Geleitwort

Das Interesse an Prognosen und damit auch der Bedarf an geeigneten Methoden wächst ständig. Die Wissenschaft begegnet diesem Interesse durch die Erweiterung des Methodenvorrats.

In der vorliegenden Arbeit von Frank Richter zeigt er die Vorteile von Kombinationsmodellen anhand des Problems der Wechselkursprognose. Die Wechselkursprognose gilt als schwierig und ist somit eine Herausforderung für jedes Prognoseverfahren. Die Arbeit behandelt das Verfahren der Künstlichen Neuronalen Netze und entwickelt einen Ansatz, mit dem einzelne Modelle sinnvoll zu einer Kombination zusammengefasst werden können. Erstmals verwendet der Autor in diesem Kontext eine für die Wechselkursprognose adäquate Nutzenfunktion zur Bildung der Kombinationsmodelle. Dies wird durch den Einsatz eines lokalen Optimierungsverfahrens ermöglicht, das von Frank Richter entsprechend angepasst wurde. Die Ergebnisse zeigen, dass dieser Ansatz anderen Prognoseverfahren überlegen ist. Schließlich entwickelt der Autor noch spezielle Operatoren, um Kombinationsmodelle mit Genetischen Algorithmen zu optimieren und stellt die Ergebnisse anhand eines Testbeispiels dar. Dieser Lösungsweg wird einleuchtend dargestellt und ist sorgfältig in das wissenschaftliche Umfeld eingeordnet.

Die Lektüre der Arbeit ist einem Leserkreis zu empfehlen, der sich einen Überblick über die Eignung und Möglichkeiten von Künstlichen Neuronalen Netzen für die Wechselkursprognose verschaffen möchte und der sich für die Verwendung moderner Konzepte der heuristischen Optimierung von Künstlichen Neuronalen Netzen interessiert.

Prof. Dr. Heinz Schaefer