

Thema: Approximation von Finanzprodukten mit neuronalen Netzen

Beschreibung: Machine Learning ist auch in der Finanzwelt in aller Munde und intelligente Algorithmen versuchen den Takt an der Wall Street zu verstehen, um zukünftige Entwicklungen bestmöglich zu prognostizieren. In dieser Websession widmen wir uns dem Themenkomplex der neuronalen Netze und legen den Fokus dabei auf konkrete Beispiele aus der Finanzpraxis.

Im ersten Teil der Websession wollen wir neuronale Netze verstehen, mit dem Ziel, selbstständig eine Architektur zu entwerfen. Neben den theoretischen Grundlagen werden wir ebenfalls einen Blick auf gängige Software wie Python werfen.

Im zweiten Teil der Websession konzentrieren wir uns auf zwei praktische Fallstudien. Zunächst betrachten wir die Bewertung von amerikanischen Optionen mittels regressionsbasierter Monte Carlo Methoden und trainieren neuronale Netze, um Optionspreise mit einer hohen Genauigkeit zu ermitteln. High-Frequency und Algorithmic Trading sowie das Superhirn Aladdin von BlackRock nutzen schon lange die Mächtigkeit von Machine Learning. Was verbirgt sich dahinter? Dies wollen wir in unserer zweiten Fallstudie durchleuchten und die Anwendungsgebiete von neuronalen Netzen an den Aktienmärkten kennenlernen.

Die Websession richtet sich an Praktiker und Akademiker mit quantitativem Hintergrund. Aktuarielle Kenntnisse werden nicht vorausgesetzt.

Referent: Dr. Christian Jonen (Generali Deutschland AG)

Termin/Uhrzeit: 16. September 2020, 10:00 – 12:00 Uhr

Kosten: 100,00 €/120,00 € zzgl. MwSt. für Mitglieder/Nicht-Mitglieder

Wir freuen uns auf Ihre [Anmeldung](#)!