

# Prognose von Zeitreihen mit Hilfe von künstlichen neuronalen Netzen am Beispiel von Börsenprognosen

Vortrag zur Seminararbeit

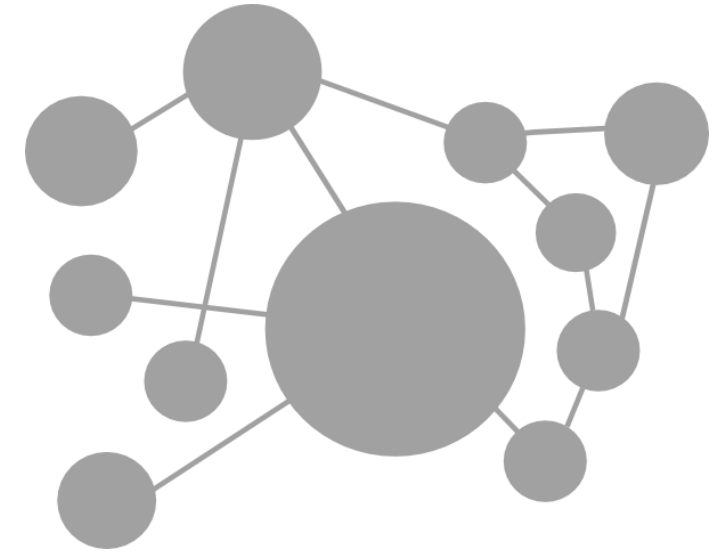
Fach: Softcomputing  
Dozent: Prof. Dr. Reinhard Eck

Vorgelegt von:

- Sebastian Schötteler
- Benedikt Hofrichter

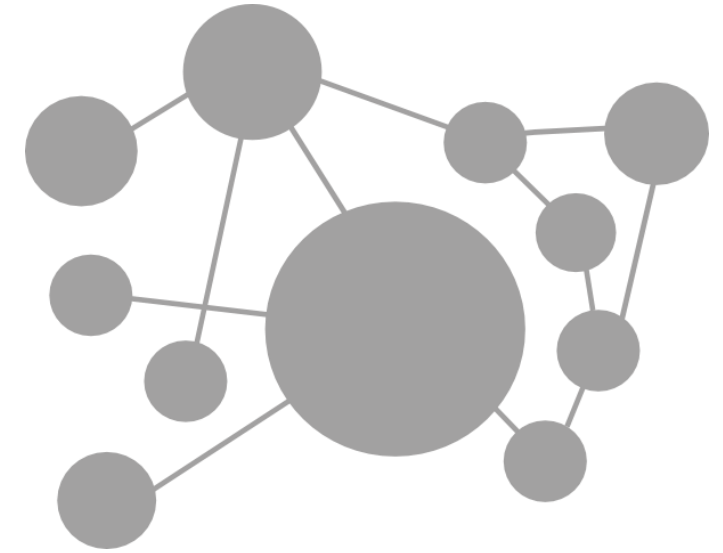
# Inhaltsverzeichnis

- I. Motivation
- II. Konzeption der Anwendung
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes
- IV. Umsetzung der Anwendung
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes
- VI. Livedemonstration der Anwendung
- VII. Analyse
- VIII. Fazit



# Inhaltsverzeichnis

- I. **Motivation**
- II. Konzeption der Anwendung
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes
- IV. Umsetzung der Anwendung
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes
- VI. Livedemonstration der Anwendung
- VII. Analyse
- VIII. Fazit



# I. Motivation

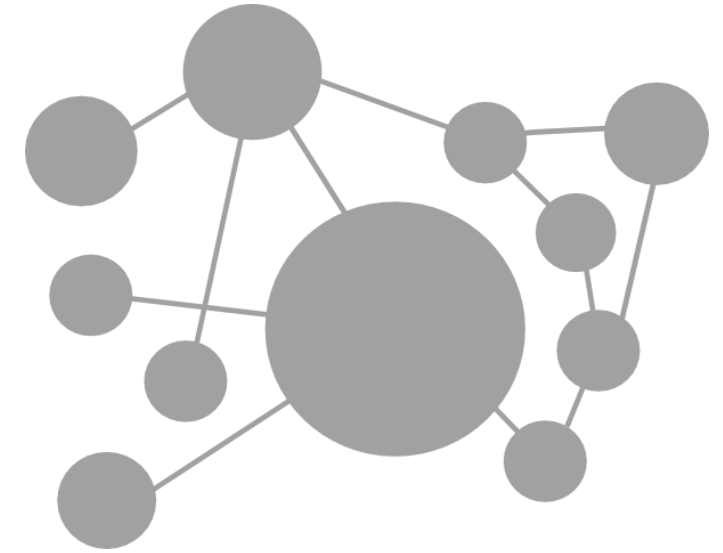
- Künstliche neuronale Netze als Hilfsmittel zur Prognose:
  - Therapieverläufen in der Medizin
  - Arbeitslosenzahlen auf dem Arbeitsmarkt
  - Börsenkursen
- Besonderheit:
  - Fähigkeit, nichtlineare Zusammenhänge zu erkennen.
  - Prognostiziert objektiv und vorurteilsfrei.

# I. Motivation

- Zweck der Seminararbeit:
  - Erstellung einer Anwendung zur Prognose von Börsenkursen mittels KNN.
    - Fokus : Erlangen eines Grundverständnisses über Prognosen mittels KNN.
    - Präzision der Prognosen sollte jedoch nicht vernachlässigt werden.
- Die Anwendung soll in der Lage sein...
  - ...den zukünftigen Kurs verschiedener Börsen prognostizieren zu können.
  - ...eine genaue statistische Analyse der Prognose liefern.

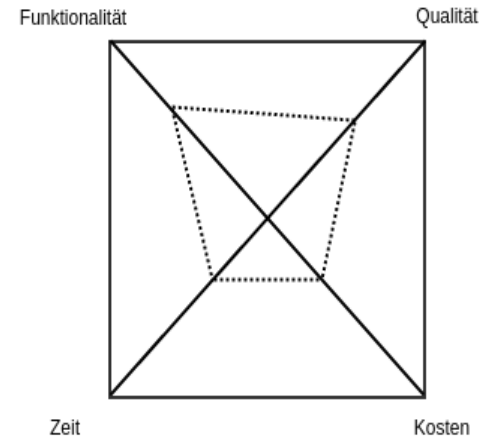
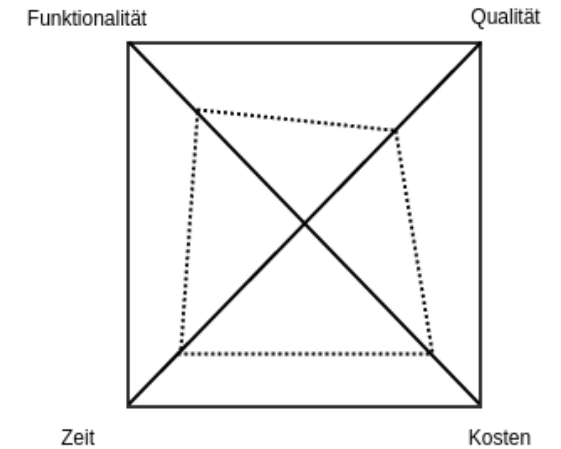
# Inhaltsverzeichnis

- I. Motivation
- II. Konzeption der Anwendung**
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes
- IV. Umsetzung der Anwendung
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes
- VI. Vorstellung des Oberfläche
- VII. Analyse
- IX. Fazit

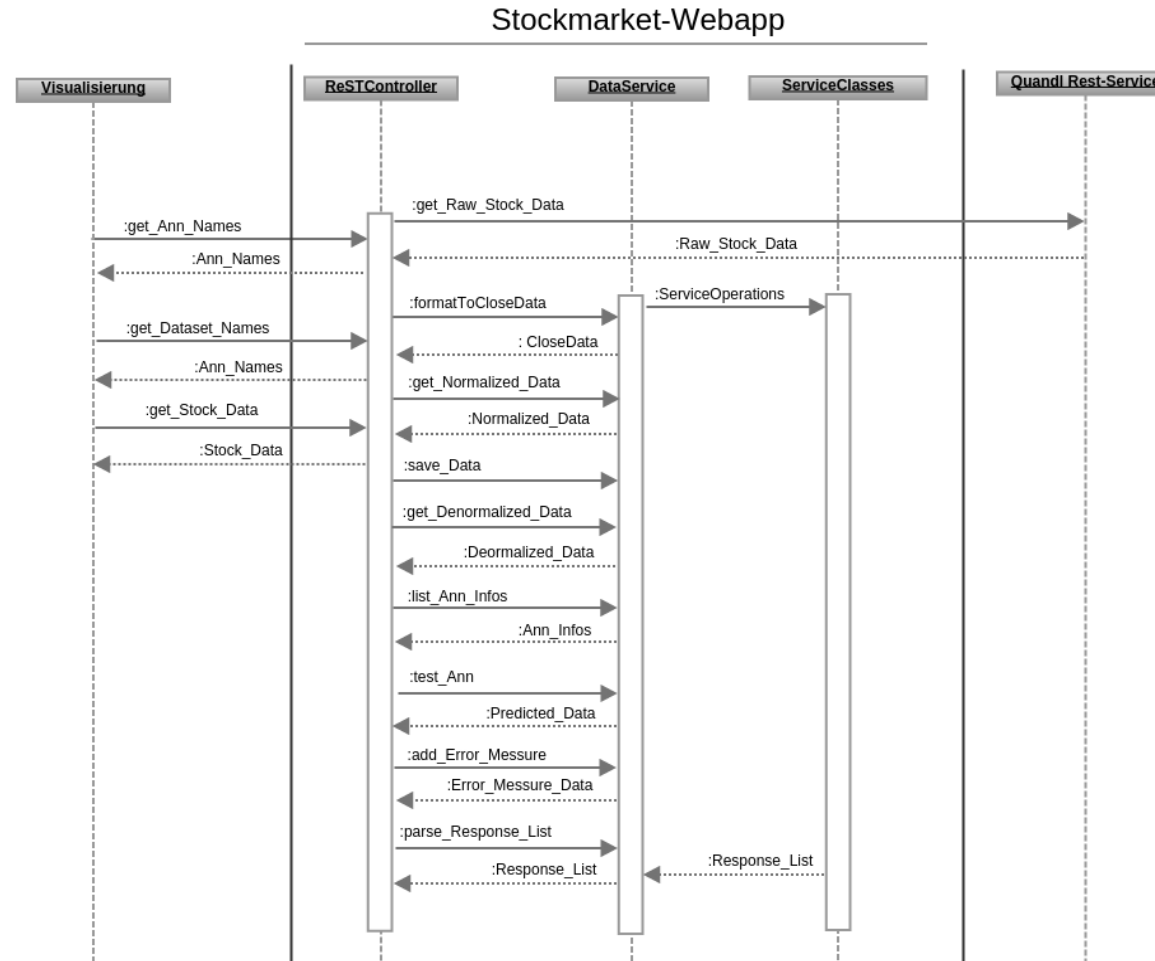


## II. Konzeption der Anwendung

- Entscheidungsfaktoren
  - Integrationsfähigkeit
  - Abstraktionsfähigkeit
  - Skalierbarkeit
  - Kosten
  - Schnittstellen



## II. Konzeption der Anwendung





## II. Konzeption der Anwendung

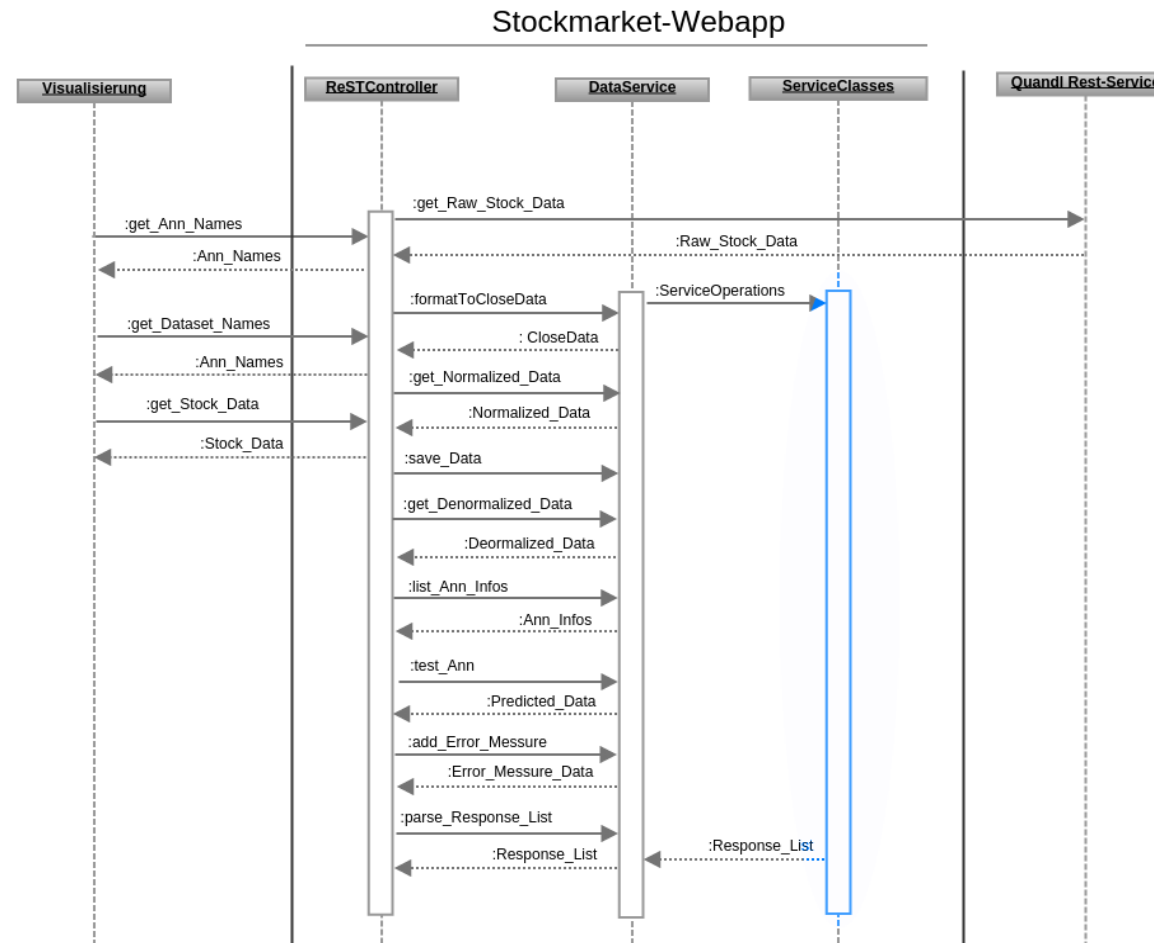
- Grundidee der Architektur
  - Anwendung besteht aus zwei Modulen
  - Anwendungslandschaft aus drei Modulen
  - Strikte Trennung zwischen Komponenten
  - Restful Kommunikation
  - Visualisierung (Client)
  - Stockmarket-Webapp (Client / Server)
  - Quandl-API (Server)

## II. Konzeption der Anwendung

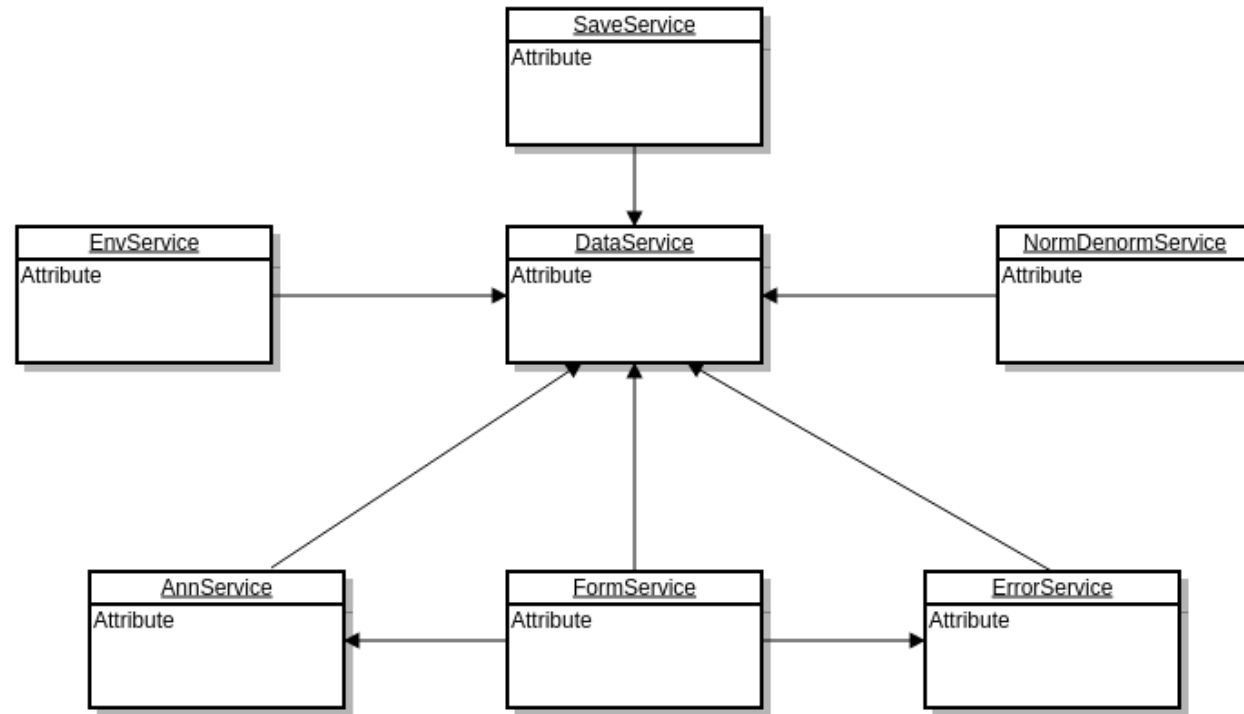
- Rest-Kommunikation
  - Adressierbarkeit
  - Variierende Repräsentationen
  - Zustandslosigkeit
  - Zustandsloses Protokoll

RESTful API  
GET PUT POST DELETE

## II. Konzeption der Anwendung

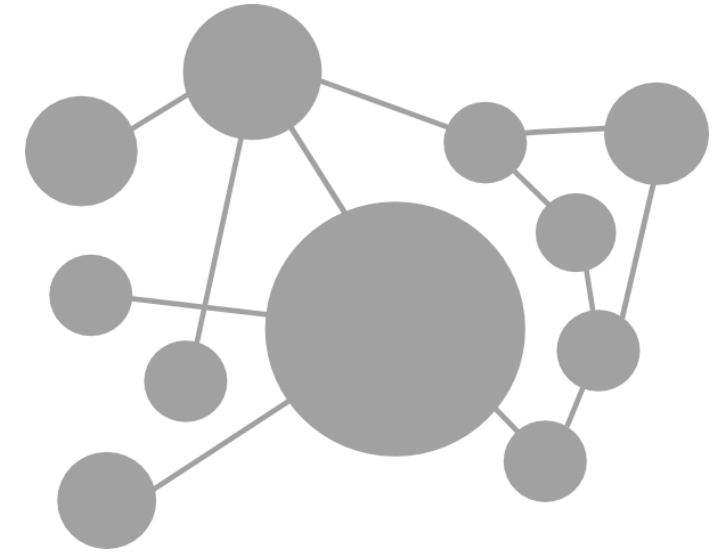


## II. Konzeption der Anwendung



# Inhaltsverzeichnis

- I. Motivation
- II. Konzeption der Anwendung
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes**
- IV. Umsetzung der Anwendung
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes
- VI. Livedemonstration der Anwendung
- VII. Analyse
- VIII. Fazit



# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Netztyp

### ■ Heteroassoziative Netze:

- $\vec{V}_i(1, \dots, n) \rightarrow \vec{V}_o(1, \dots, k); k \leq n$

### ■ Autoassoziative Netze:

- $\vec{V}_i(1, \dots, n) \rightarrow \vec{V}_o(1, \dots, n)$

Heteroassoziative Netze	Autoassoziative Netze
Adaline	Hopfield-Netze
Madaline	Boltzmann-Maschine
Perzeptron	
Multilayerperzeptron	

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

- Netztyp
  - Wir bilden einen Eingabevektor auf einen skalaren Wert ab.

Heteroassoziative Netze	Autoassoziative Netze
Adaline	Hopfield-Netze
Madaline	Boltzmann-Maschine
Perzeptron	
Multilayerperzeptron	

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Netztyp

- Definition & Theorem zur weiteren Bestimmung des Netztyps
  - Definition der linearen Separierbarkeit.
  - Beweis der eingeschränkten Fähigkeit von einschichtigen neuronalen Netzen.
  - Konvergenz-Theorem von Rosenblatt & Theorem der universellen Approximation.

?

Heteroassoziative Netze	Autoassoziative Netze
Adaline	Hopfield-Netze
Madaline	Boltzmann-Maschine
Perzeptron	
Multilayerperzeptron	



# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Netztyp

### ■ Definition der linearen Separierbarkeit:

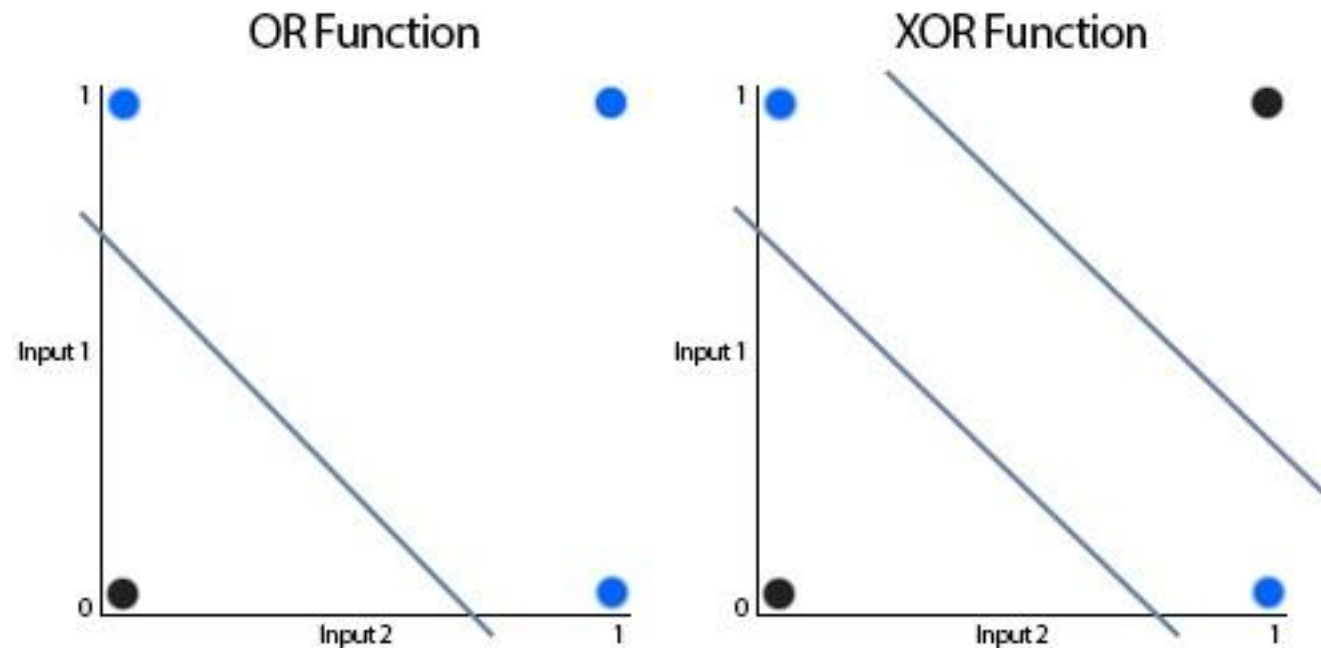
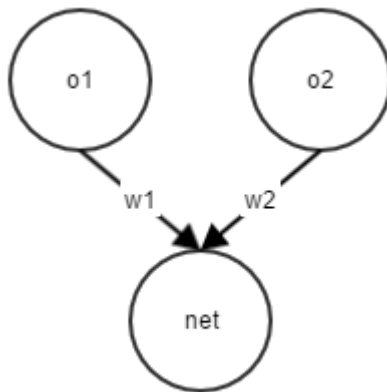
Seien  $X_1$  und  $X_2$  zwei Wertemengen im  $n$ -dimensionalen euklidischen Raum. Diese sind genau dann linear separierbar, wenn  $n + 1$  reelle Zahlen  $w_1 \dots w_n, k$  existieren, sodass für alle  $x \in X_1, y \in X_2$  die folgende Ungleichung erfüllt ist:

$$\sum_{i=1}^n w_i x_i \leq k < \sum_{i=1}^n w_i y_i$$

- 2 Klassen sind linear separierbar, wenn ihre konvexen Hüllen disjunkt sind.
- 2 Klassen sind linear separierbar, wenn sie durch eine Gerade geteilt werden können.

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

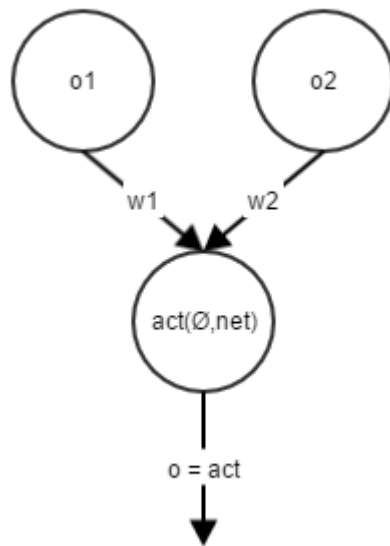
- Netztyp
  - Einschichtige neuronale Netze können nur linear separierbare Funktionen klassifizieren



# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Netztyp

- Kontradiktionsbeweis der eingeschränkten Fähigkeit von einschichtigen neuronalen Netzen beim XOR-Problem nach Minski / Papert:



Gegeben:

$$net = o_1 * w_1 + o_2 * w_2$$
$$f_{out}(act) = Id \rightarrow o = act$$

a)  $0 * w_1 + 0 * w_2 < 0$  Inputvektor (0,0) liefert den Output 0.

b)  $0 * w_1 + 1 * w_2 \geq 0$  Inputvektor (0,1) liefert den Output 1.

c)  $1 * w_1 + 0 * w_2 \geq 0$  Inputvektor (1,0) liefert den Output 1.

d)  $1 * w_1 + 1 * w_2 < 0$  Inputvektor (1,1) liefert den Output 0.

→ Widerspruch:  $(b + c) : w_1 + w_2 \geq 0 \wedge (d) : w_1 + w_2 < 0$

➔ Beweis auf andere nicht linear separierbare Funktionen anwendbar.

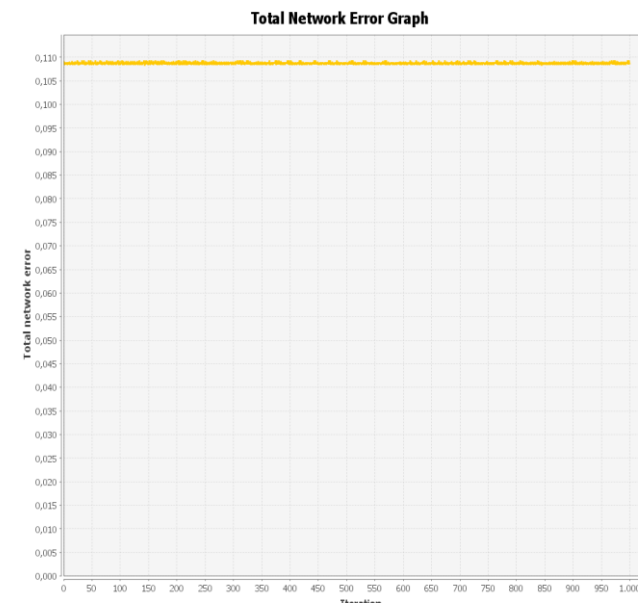
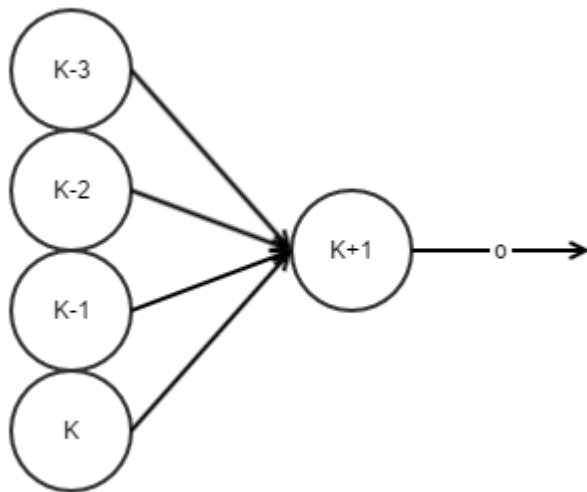
# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

- Netztyp
  - Einschichtige neuronale Netze können nur linear separierbare Funktionen klassifizieren
  - Börsenkurs linear separabel?
  - Konvergenz –Theorem:  
*„Der Lernalgorithmus des Perzeptrons konvergiert in endlicher Zeit, d.h. das Perzeptron kann in endlicher Zeit alles lernen, was es repräsentieren kann.“*  
Perzeptron konvergiert  $\leftrightarrow$  Funktion linear separabel

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Netztyp

### ■ Test auf linearer Separierbarkeit:



- Perzeptron konvergiert nicht → Börsenkurs nicht linear separabel → einlagige neuronale Netze nicht zur Prognose des Börsenkurses geeignet.

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Netztyp

Heteroassoziative Netze
Adaline
Madaline
Perzeptron
<b>Multilayerperzeptron</b>

- Ist ein Multilayerperzeptron zur Vorhersage von Börsenprognosen geeignet?
  - Theorem der universellen Approximation

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

- Netztyp
  - Ist ein Multilayerperzeptron zur Vorhersage von Börsenprognosen geeignet?
    - Theorem der universellen Approximation:  
„Mit Hilfe eines dreischichtigen neuronalen Netzes lassen sich Funktionen beliebig genau approximieren.“
    - Ein Multilayerperzeptron ist also ein universeller Approximator.
- Fazit: Multilayerperzeptron geeignet.

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

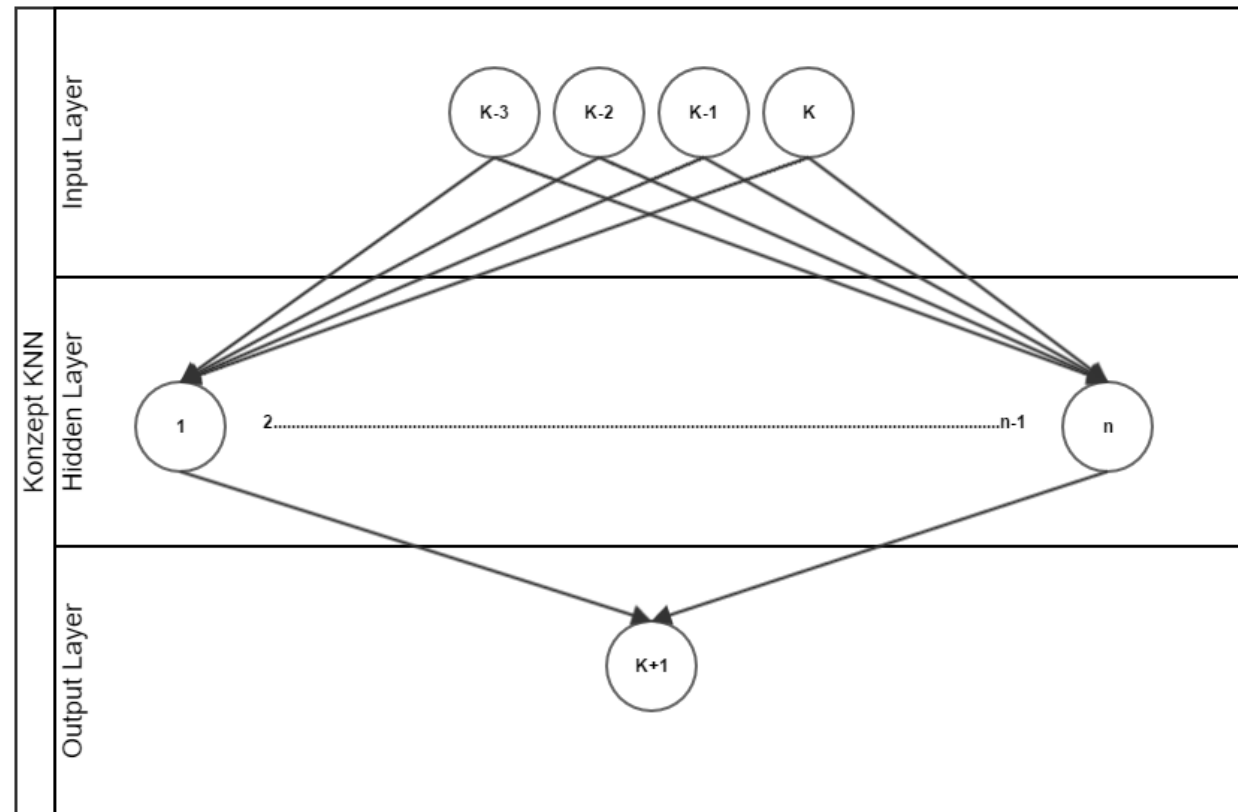
## ■ Topologie

- $K_i$  = Börsenkurs am Tag  $i$ .
- Ein Vektor  $V_i = (K_{i-3}, K_{i-2}, K_{i-1}, K_i)$  der Länge 4 als Input.
- Ein Skalarwert  $K_{i+1}$  als Output.



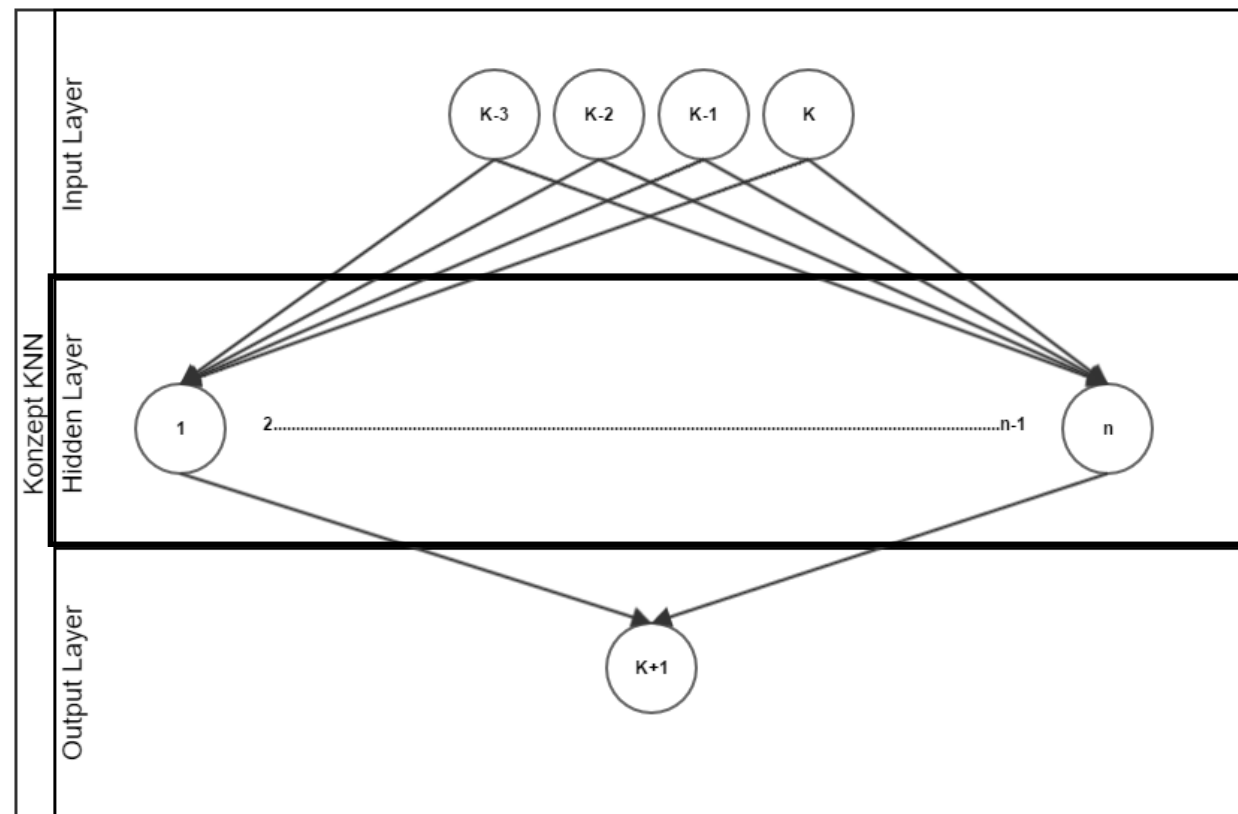
# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Topologie



# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Topologie



# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Topologie

### ■ Richtlinien zur Dimensionierung der Zwischenschicht:

- Nicht zu viele Neuronen → Overfitting vermeiden → mangelnde Gen-F.
- Nicht zu wenig Neuronen → Regelsatz kann nicht abgespeichert werden.
- Faustregel zur Ermittlung einer Obergrenze:

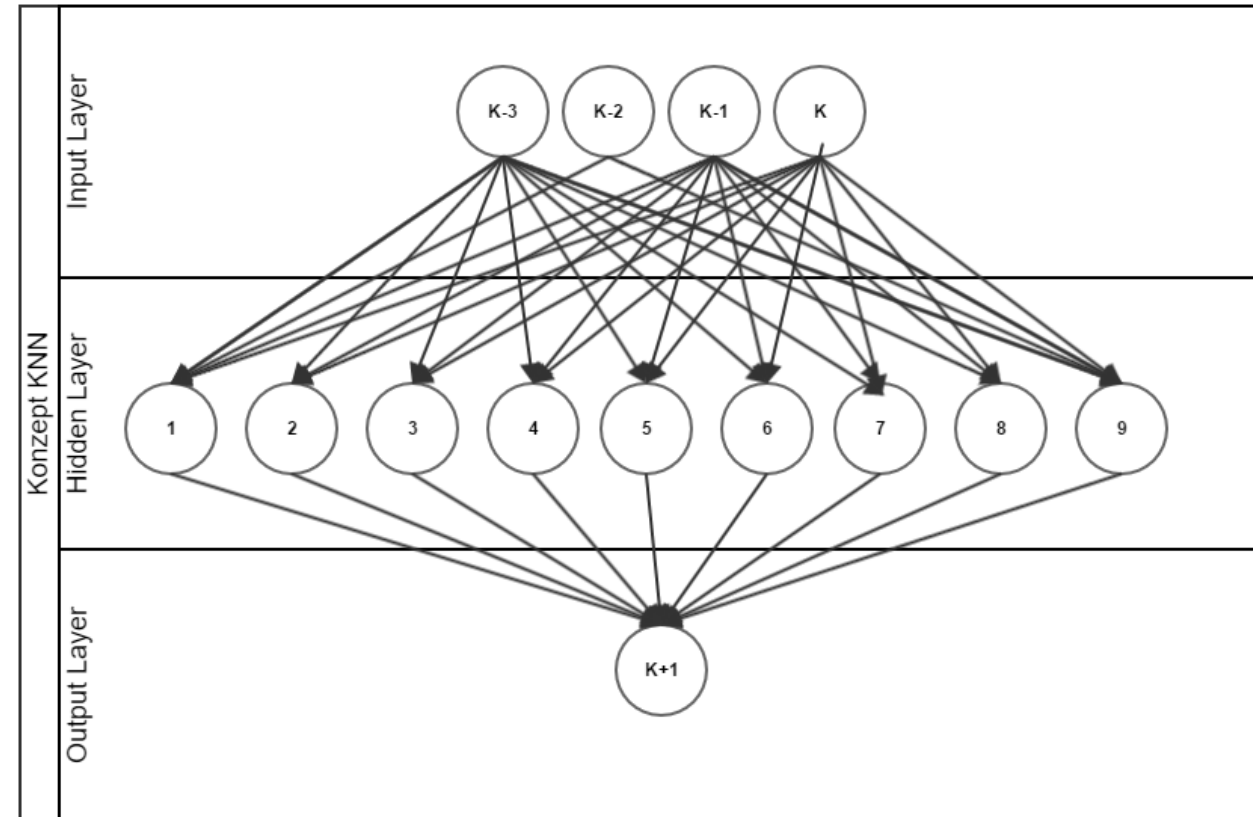
$$h = \frac{\text{Anzahl Trainingsdaten}}{10 * (m + n)} = \frac{450}{10 * (4 + 1)} = \frac{450}{50} = 9$$

Bieten nur einen Anhaltspunkt

- $h$  = Obergrenze für die Anzahl der Neuronen in der versteckten Schicht.
- Es werden 450 Trainingsdaten und 150 Testdaten verwendet.
- $m$  = Anzahl Inputneuronen;  $n$  = Anzahl Outputneuronen.

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Topologie



# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

- Lernverfahren
  - Überwachtes Lernen
    - Eingabewerte bekannt
    - Erwartete Ausgabewerte bekannt
    - Tatsächlicher Wert wird mit erwarteten Ausgabewert verglichen.
    - Differenz wird gebildet und zum „trainieren“ des Netzes genutzt.
  - Bestärkendes Lernen
    - Ähnlich wie überwachtes Lernen.
    - Anwendbar, wenn keine Ausgabewerte zur Verfügung stehen.
    - Netz erhält nur Information ob richtig oder falsch und muss damit trainiert werden.
  - Nicht überwachtes Lernen
    - Sehr nah am biologischen Vorbild.
    - Das Neuronale Netz verändert sich entsprechend den Eingabemustern von selbst.

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

- Lernverfahren
  - Überwachtes Lernen
    - Eingabewerte bekannt
    - Erwartete Ausgabewerte bekannt
    - Tatsächlicher Wert wird mit erwarteten Ausgabewert verglichen.
    - Differenz wird gebildet und zum „trainieren“ des Netzes genutzt.
  - Bestärkendes Lernen
    - Ähnlich wie überwachtes Lernen.
    - Anwendbar, wenn keine Ausgabewerte zur Verfügung stehen.
    - Netz erhält nur Information ob richtig oder falsch und muss damit trainiert werden.
  - Nicht überwachtes Lernen
    - Sehr nah am biologischen Vorbild.
    - Das Neuronale Netz verändert sich entsprechend den Eingabemustern von selbst.

# III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Lernverfahren

### ■ Überwachtes Lernen

- Eingabewerte bekannt
- Erwartete Ausgabewerte bekannt
- Tatsächlicher Wert wird mit erwarteten Ausgabewert verglichen.
- Differenz wird gebildet und zum „trainieren“ des Netzes genutzt. → MSE

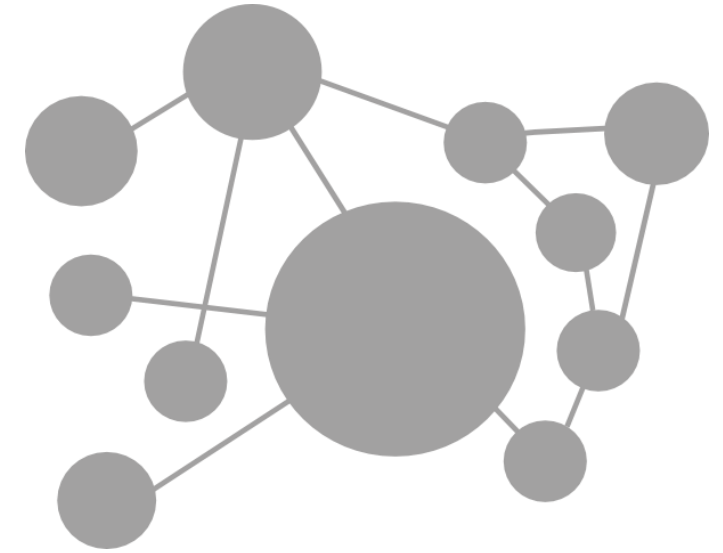
### ■ MSE - Funktion:

$$MSE = \frac{1}{2} \sum_j^n ((k_{i+1})_j - (k_{i+1}')_j)^2$$

- $k_{i+1}$  = Prognostizierter Kurs des KNN zum Tag  $i + 1$ .
- $k_{i+1}'$  = Echter Kurs zum Tag  $i + 1$ .

# Inhaltsverzeichnis

- I. Motivation
- II. Konzeption der Anwendung
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes
- IV. Umsetzung der Anwendung**
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes
- VI. Livedemonstration der Anwendung
- VII. Analyse
- VIII. Fazit





# IV. Umsetzung der Anwendung

Entwicklung	Laufzeit
Java 8 – JDK 1.8	Java 8 – JRE 1.8
Tomcat 7.0.64	Tomcat 7.0.64
Intellij IDE	
Linux Mint 17.1	
Neuroph-Studio-2.92	

- Vorteile:
  - Betriebssystemunabhängigkeit
  - Kontextbasierte Entwicklung
  - Neuroph ist eine Java-Anwendung

# IV. Umsetzung der Anwendung

- Frameworks
  - Apache Maven
  - Spring Boot
  - C3js
  - Bootstrap

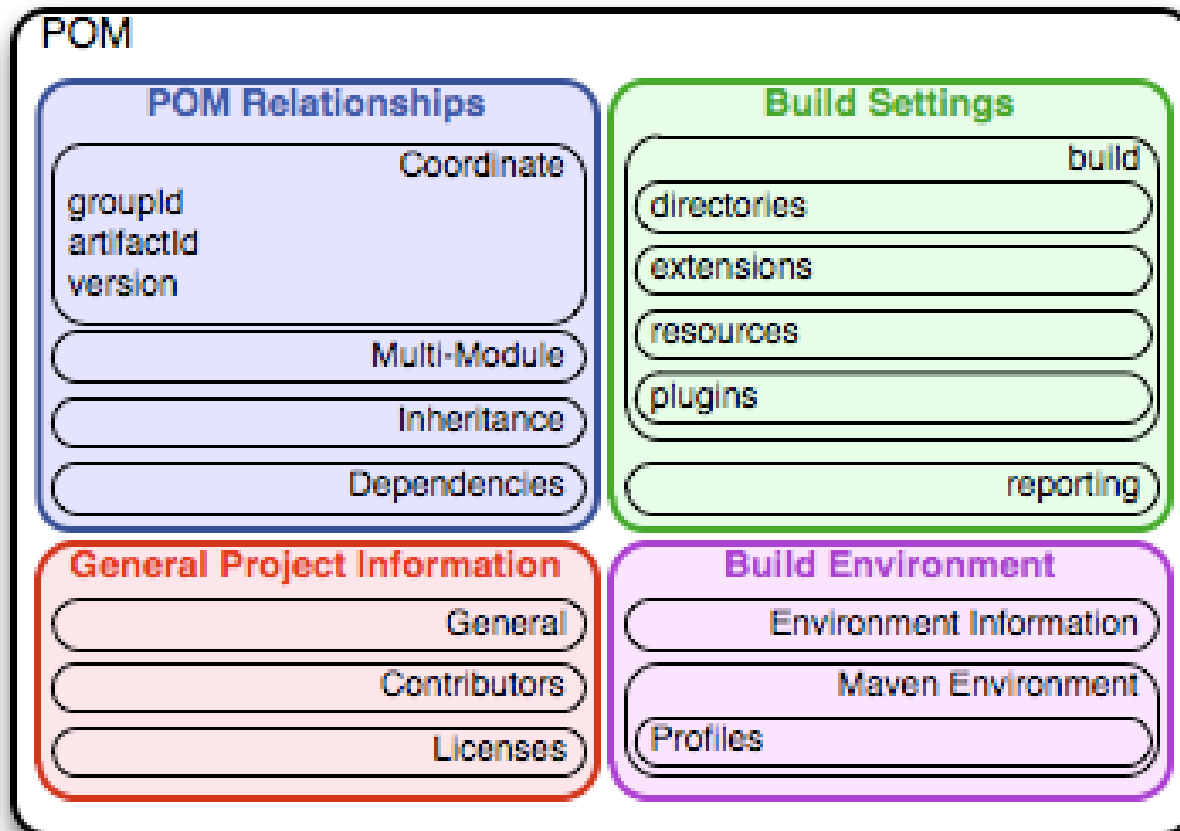


# IV. Umsetzung der Anwendung

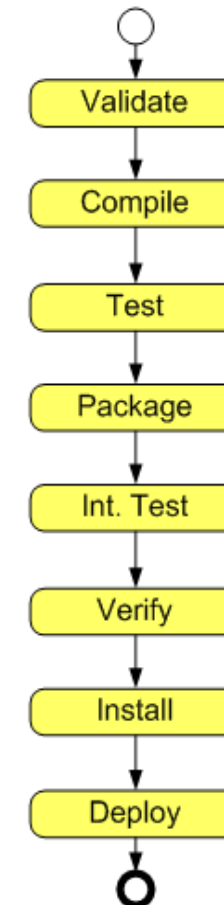


- Apache Maven
  - Build-Werkzeug
  - Abhängigkeiten-Management (Dependency Management)
  - Local und Remote Repositories
  - Maven-Build-Lifecycle
  - Anwendungsspezifisches Management definiert das Project Object Model (POM.xml)
  - Alternativen sind Apache Ant und Gradle
  - Vorteile: Skalierbarkeit, Komplexitätsverringering ...

# IV. Umsetzung der Anwendung



Maven Build Lifecycle



# IV. Umsetzung der Anwendung

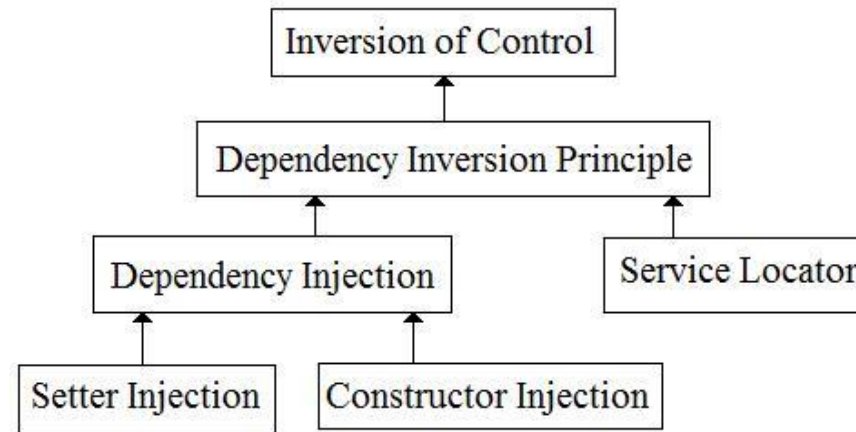
- Spring Boot
  - Umsetzung des Spring Frameworks
  - Besseres Code Management
  - Vermeidung von Boiler Plate Code
  - Elementare Bestandteile
    - Abhängigkeitsinjizierung (Dependency Injection)
    - Annotationen



# IV. Umsetzung der Anwendung

- Abhängigkeit-Injizierung
  - Entwurfsmuster (Software Pattern)
  - Ziel: Abhängigkeitsminimierung zwischen Java-Klassen
- Abhängigkeiten werden beim Aufruf übergeben.
- Arten:
  - Inversion-of-Control (Spring IoC-Container)
  - Konstruktor Injektion
  - Setter Injektion

# IV. Umsetzung der Anwendung



# IV. Umsetzung der Anwendung

- Annotationen
  - Implementierung von Interface
  - Typen:
  - Retention.SOURCE – Typen
  - Retention.RUNTIME – Typen

```
@Component  
public class DataService {  
  
    @Autowired  
    private FormatService formatService;  
}
```



# IV. Umsetzung der Anwendung

- C3js – Power für die Börsencharts
  - Basiert auf D3js
  - Relativ schlanker Ansatz
  - Informationsgehalt kann angemessen dargestellt werden
  - Visualisierung aller Diagramme
  - Alternativen: D3js, NVD3, CanvasJS, Crossfilter, ...

# IV. Umsetzung der Anwendung

- Bootstrap – CSS Bibliothek
  - Entwickelt in CSS, LESS, JavaScript
  - Ermöglicht Responsive Design
  - Hauptaufgabe: Formatierung des Layouts

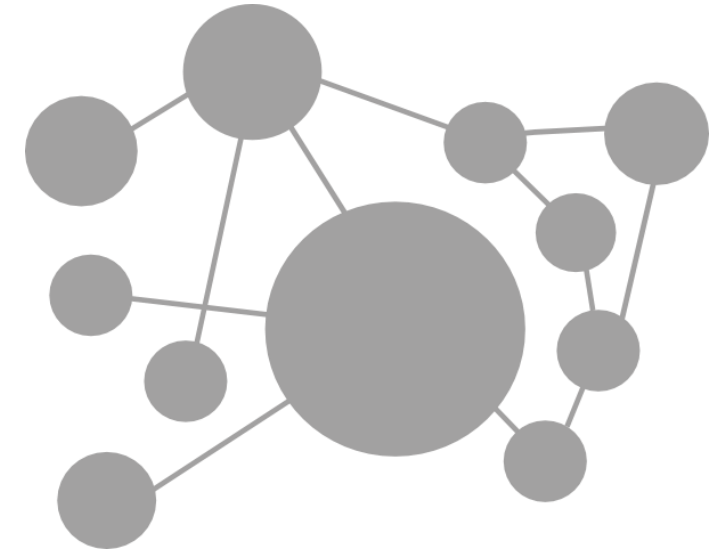


# IV. Umsetzung der Anwendung

- Technologie - Fazit
    - Integrationsfähigkeit durch modulare Entwicklung und einheitliche Schnittstellen
    - Abstraktionsfähigkeit durch intelligente Frameworks und Entwurfsmuster
    - Skalierbarkeit durch Rest-Kommunikation (Abhängigkeit-Injizierung)
- Nachhaltige Entwicklung

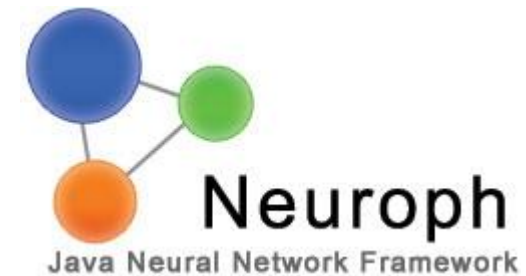
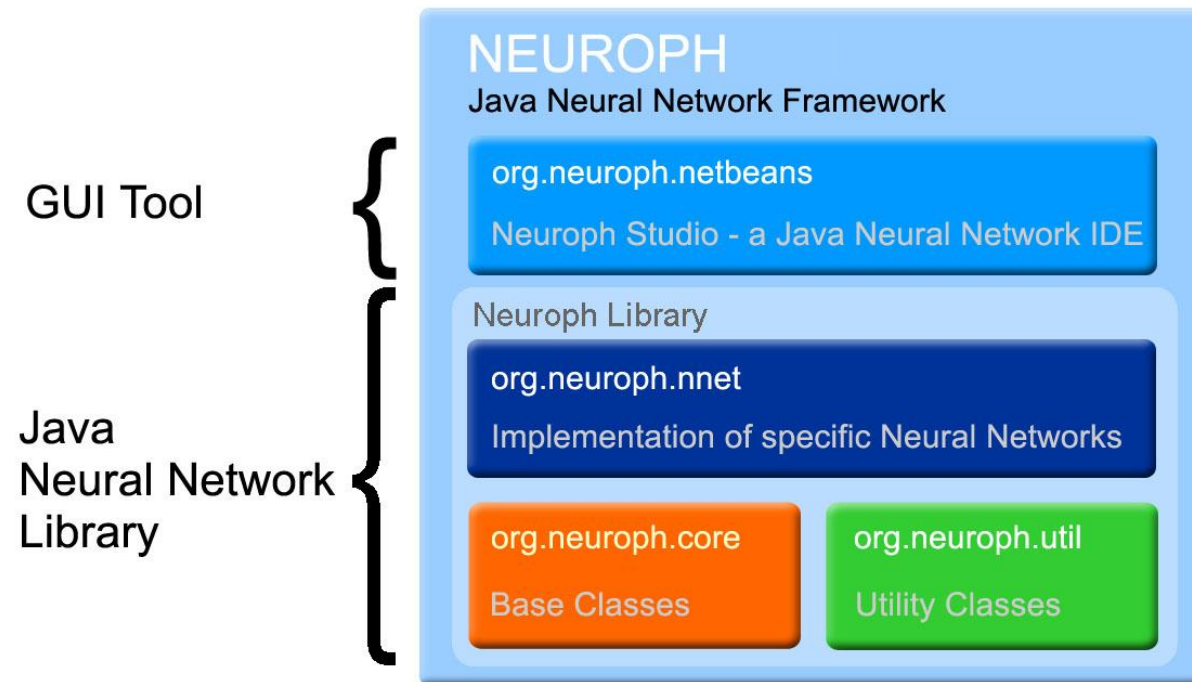
# Inhaltsverzeichnis

- I. Motivation
- II. Konzeption der Anwendung
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes
- IV. Umsetzung der Anwendung
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes**
- VI. Livedemonstration der Anwendung
- VII. Analyse
- VIII. Fazit



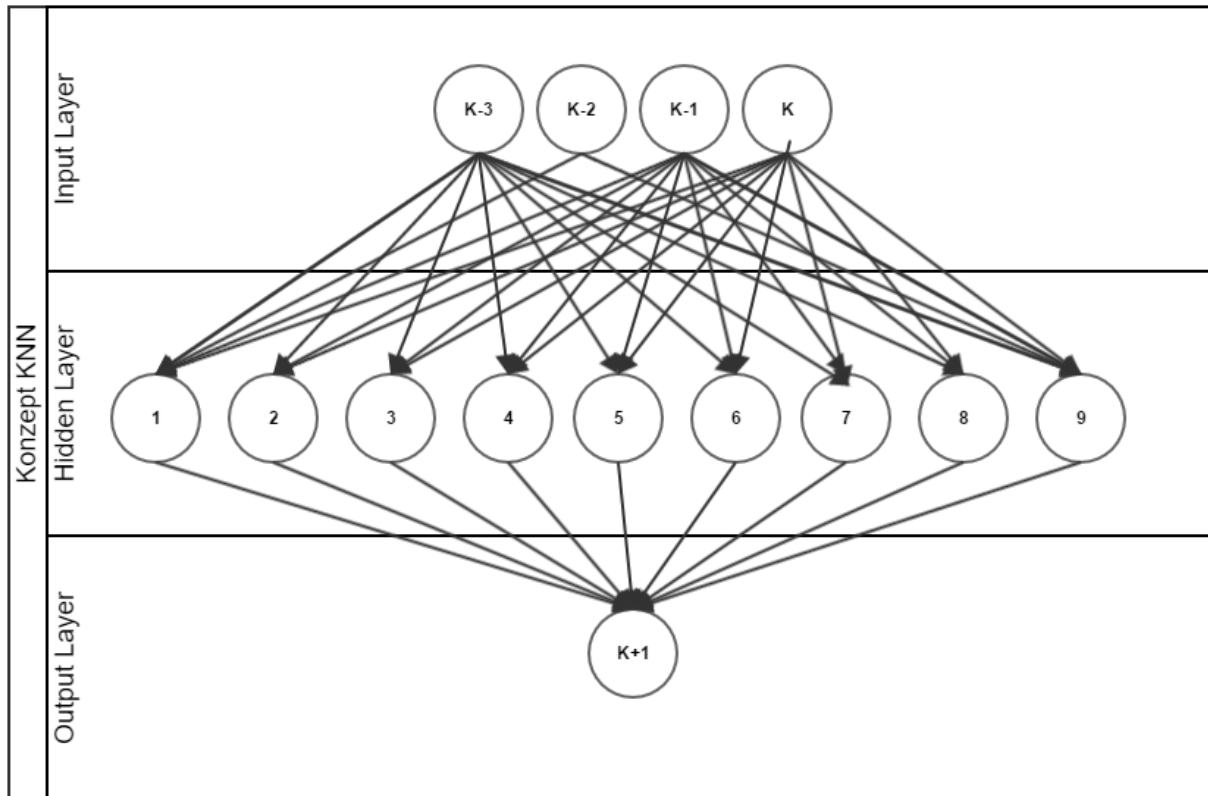
# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Umsetzung mit Neuroph Studio



# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

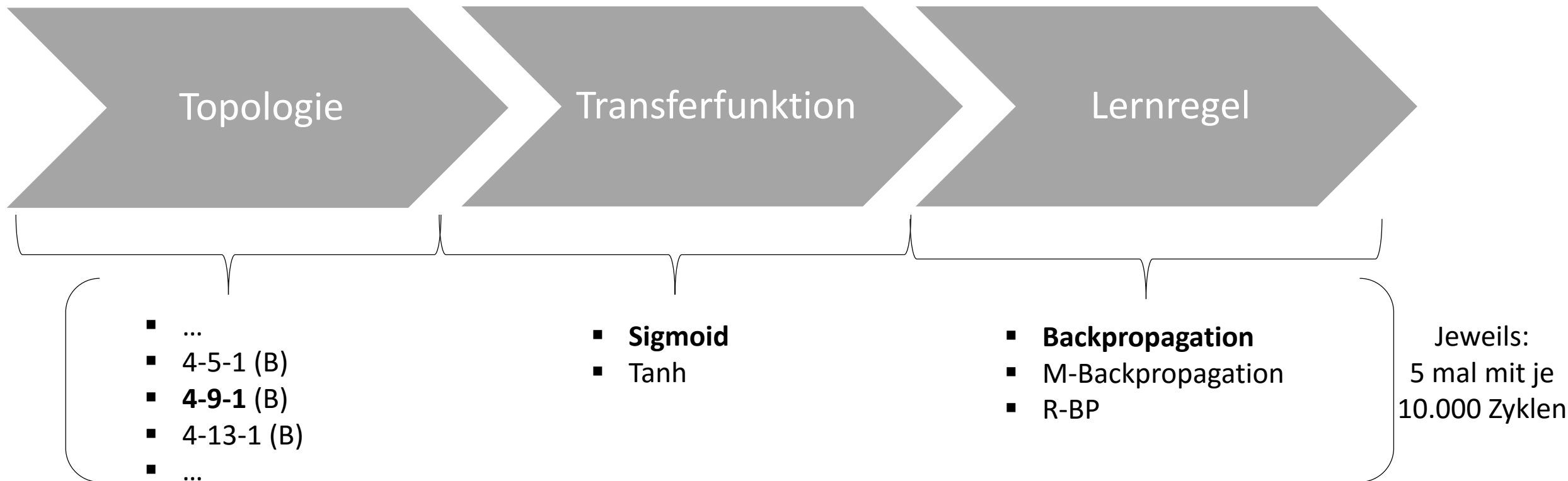
## ■ Startnetz aus der Konzeption



Topologie	4-9-1
Transferfunktion	Sigmoid
Lernregel	Backpropagation
Lernrate	0,7

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Optimierungsprozess



# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

- Datensätze
  - Trainingsdatensatz: 450 Daten
  - Testdatensatz: 150 Daten

$k_{i-3}$	$k_{i-2}$	$k_{i-1}$	$k_i$	$k_{i+1}$
0.190972570949751	0.180798476262922	0.194512109965799	0.177829447229312	0.186565381335409
0.180798476262922	0.194512109965799	0.177829447229312	0.186565381335409	0.170638644325654
0.194512109965799	0.177829447229312	0.186565381335409	0.170638644325654	0.142122653703412
0.177829447229312	0.186565381335409	0.170638644325654	0.142122653703412	0.128190324507267
0.186565381335409	0.170638644325654	0.142122653703412	0.128190324507267	0.125435236717072
0.170638644325654	0.142122653703412	0.128190324507267	0.125435236717072	0.158776790940777
0.142122653703412	0.128190324507267	0.125435236717072	0.158776790940777	0.16955467535902

Inputs

Output

Normalisierungsformel:

$$Norm = \frac{A - \min(A)}{\max(A) - \min(A)} * 0,8 + 0,1$$



# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

- Optimierung der Topologie

Topologie	MSE		MSE-BIAS	
	Training	Test	Training	Test
4-3-1 (B)	0,0011562	0,002569	$9,449 \cdot 10^{-4}$	0,001788
4-5-1 (B)	0,001062	0,002879	$9,598 \cdot 10^{-4}$	0,001799
4-7-1 (B)	0,001090	0,001784	$9,407 \cdot 10^{-4}$	0,001781
4-9-1 (B)	0,001048	0,002134	$9,488 \cdot 10^{-4}$	0,0024436
4-11-1 (B)	0,001022	0,001785	$9,760 \cdot 10^{-4}$	0,0033215
4-13-1 (B)	0,001002	0,001787	$9,906 \cdot 10^{-4}$	0,004067

- B steht hierbei für Bias-Neuron → Schnellere Konvergenz.

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Optimierung der Topologie

Topologie	MSE		MSE-BIAS	
	Training	Test	Training	Test
4-3-1 (B)	0,0011562	0,002569	$9,449 \cdot 10^{-4}$	0,001788
4-5-1 (B)	0,001062	0,002879	$9,598 \cdot 10^{-4}$	0,001799
4-7-1 (B)	0,001090	0,001784	$9,407 \cdot 10^{-4}$	0,001781
4-9-1 (B)	0,001048	0,002134	$9,488 \cdot 10^{-4}$	0,0024436
4-11-1 (B)	0,001022	0,001785	$9,760 \cdot 10^{-4}$	0,0033215
4-13-1 (B)	0,001002	0,001787	$9,906 \cdot 10^{-4}$	0,004067

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Optimierung der Transferfunktion

Transferfunktion	MSE	
	Training	Test
Sigmoid	$9,406 \cdot 10^{-4}$	0,001767
Tanh	0,010333	0,044330

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Optimierung der Transferfunktion

Transferfunktion	MSE	
	Training	Test
Sigmoid	$9,406 \cdot 10^{-4}$	0,001767
Tanh	0,010333	0,044330

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Optimierung der Lernregel

Lernregel	MSE	
	Training	Test
Backpropagation	$9,325 \cdot 10^{-4}$	0,001636
Momentum Backpropagation	$9,109 \cdot 10^{-4}$	0,001608
Resilient Propagation	$8,89 \cdot 10^{-4}$	$9,406 \cdot 10^{-4}$

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

- Optimierung der Lernregel

Lernregel	MSE	
	Training	Test
Backpropagation	$9,325 \cdot 10^{-4}$	0,001636
Momentum Backpropagation	$9,109 \cdot 10^{-4}$	0,001608
Resilient Propagation	$8,89 \cdot 10^{-4}$	$9,406 \cdot 10^{-4}$

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

- RPROP → „Federndes“ Propagation:
  - Verfahren ändert Gewichte nur durch Vorzeichen des Gradienten.
    - Dazu wird der Kurvenanstieg von  $t$  und herangezogen (namens  $S(t)$ )

$$\Delta w_{ij}(t) = \begin{cases} -\Delta_{ij}(t) & \text{falls } S(t) > 0 \\ +\Delta_{ij}(t) & \text{falls } S(t) < 0 \\ 0 & \text{sonst} \\ - & \end{cases}$$

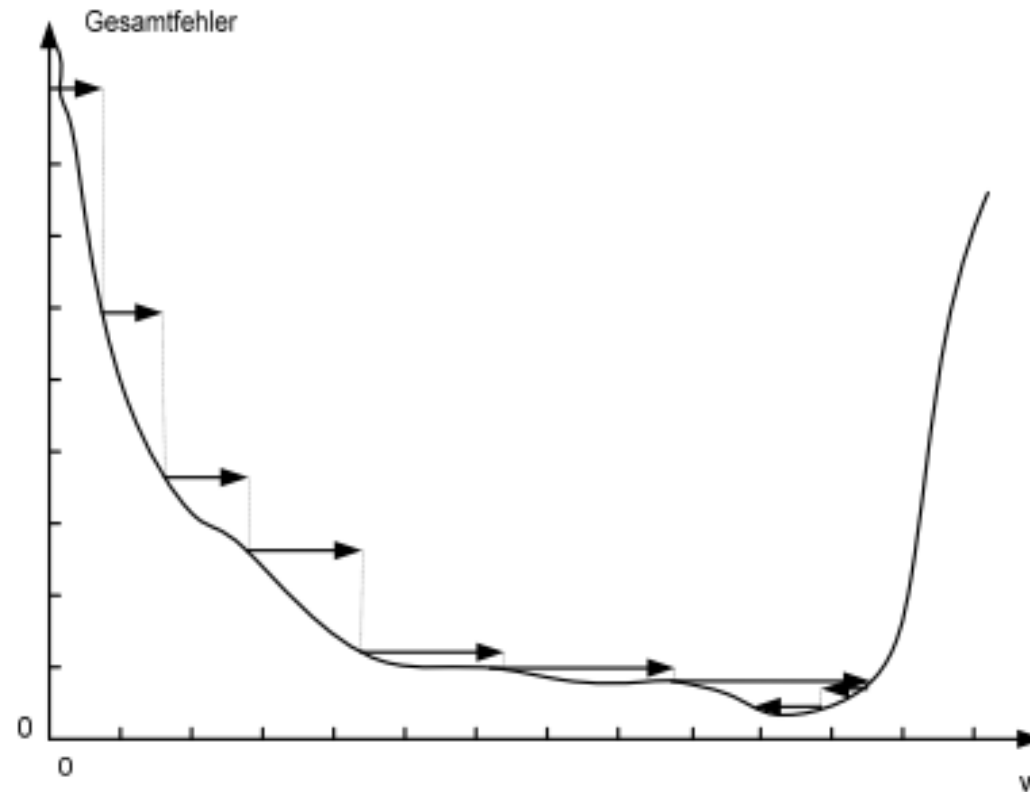
# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

- RPROP → „Federndes“ Propagation:
  - Betrag der Gewichtsveränderung  $\Delta_{ij}$  wird getrennt bestimmt:
    - Zwei konstante Parameter  $n_+$  und  $n_-$  mit  $0 < n_- < 1 < n_+$

$$\Delta_{ij}(t) = \begin{cases} \Delta_{ij}(t-1) \cdot n_+ & \text{falls } S(t-1) \cdot S(t) > 0 \\ \Delta_{ij}(t-1) \cdot n_- & \text{falls } S(t-1) \cdot S(t) < 0 \\ \Delta_{ij}(t-1) & \text{sonst} \end{cases}$$



# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

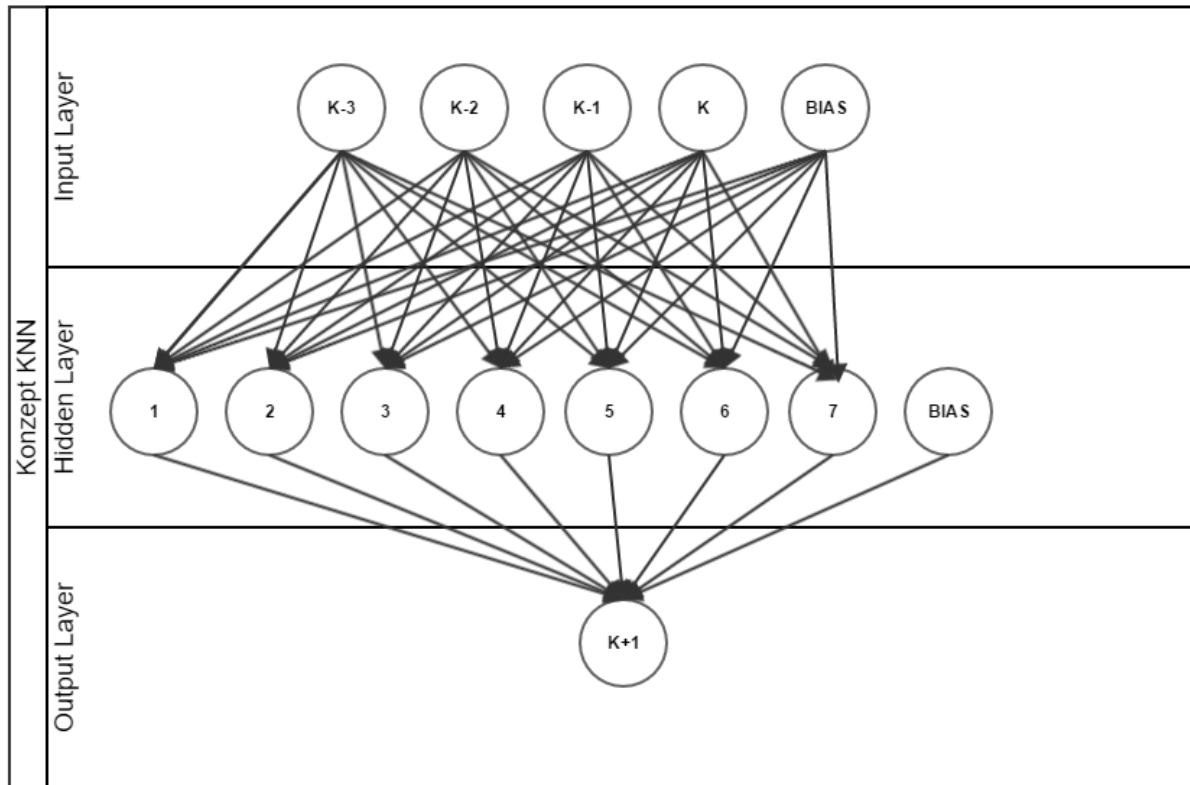


# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

- Resilient Propagation:
  - Sehr effizienter Backpropagation-Algorithmus.
  - Verfügt über keine Lernrate.
  - Benötigt keinen Momentum-Faktor.
  - Ist in der Praxis meistens anderen Lernregeln überlegen.

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Endgültiges Netz – DAX



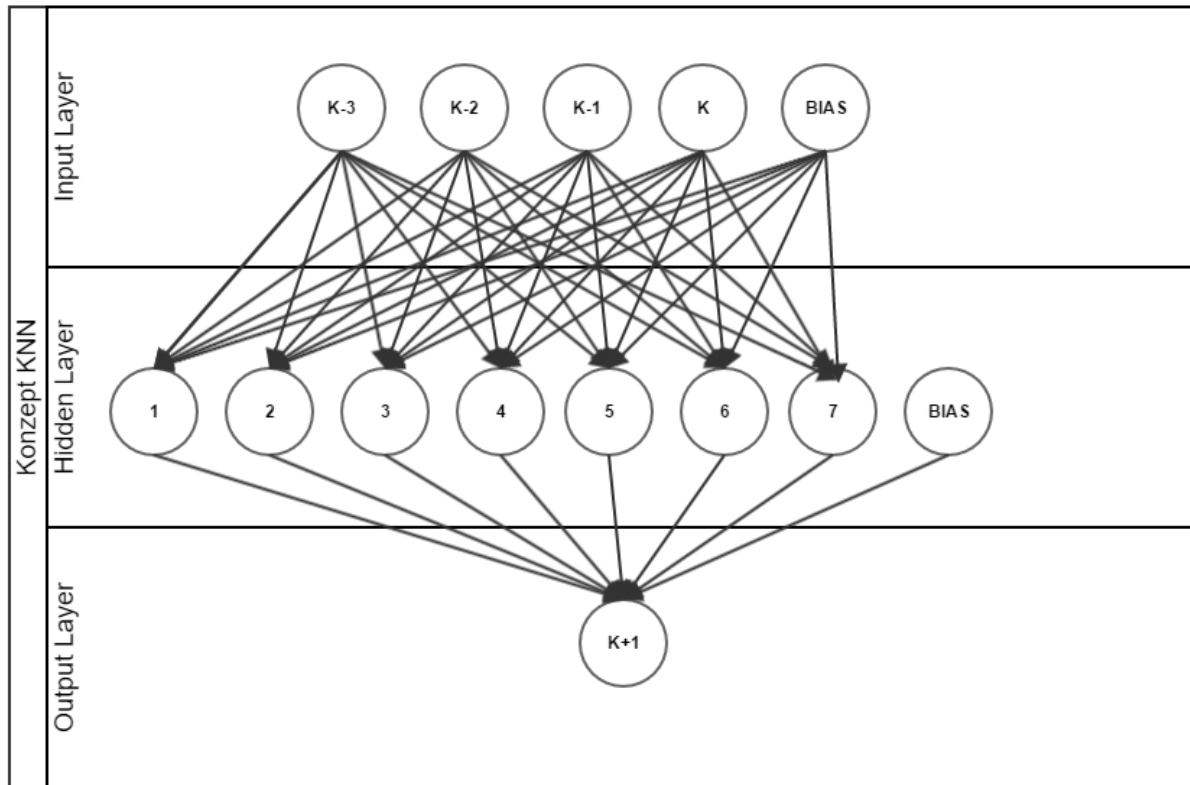
Topologie	4-7-1 mit BIAS
Transferfunktion	Sigmoid
Lernregel	R-Prop

Endgültiges Netz nochmals mit 200.000 Zyklen trainiert und getestet:

- MSE-Training:  $4,252 \cdot 10^{-5}$
- MSE-Test:  $4,820 \cdot 10^{-5}$

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Analog – Nikkei 225



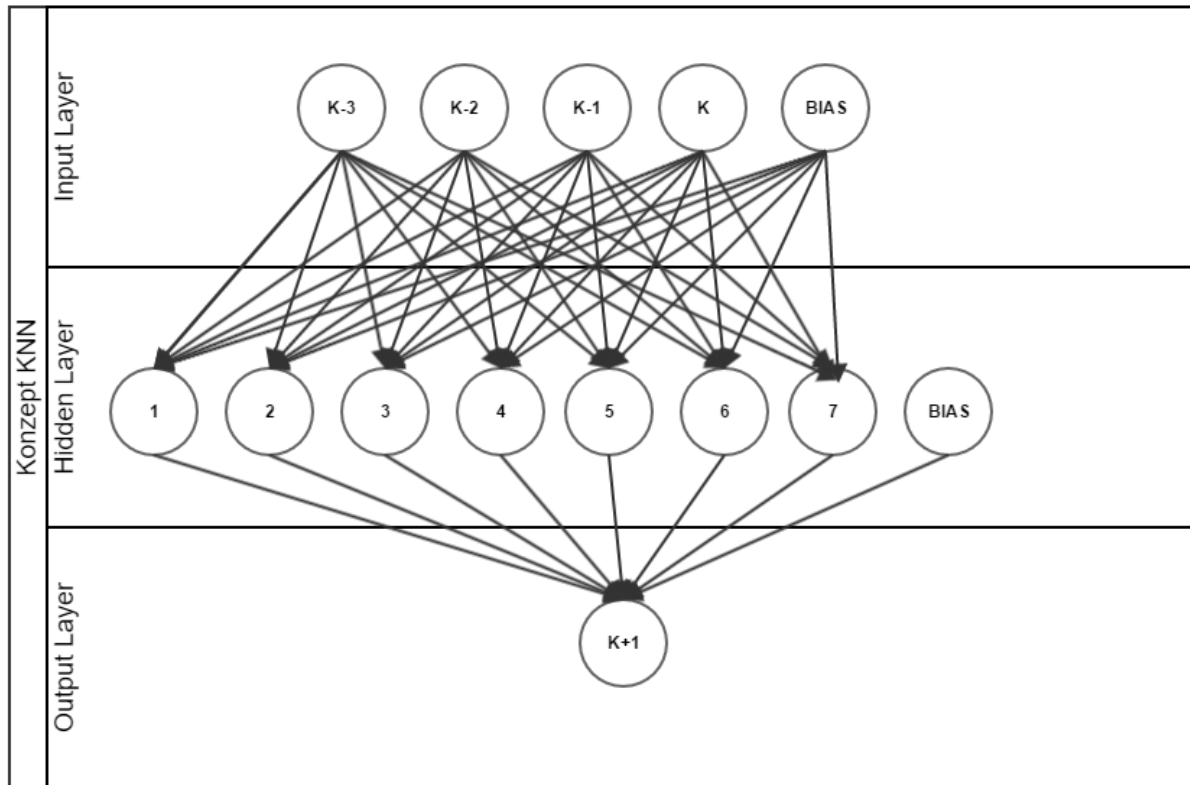
Topologie	4-7-1 mit BIAS
Transferfunktion	Sigmoid
Lernregel	R-Prop

Endgültiges Netz nochmals mit 200.000  
Zyklen trainiert und getestet:

- MSE-Training:  $1.350 \cdot 10^{-5}$
- MSE-Test:  $4,520 \cdot 10^{-5}$

# V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes

## ■ Analog – Dow Jones



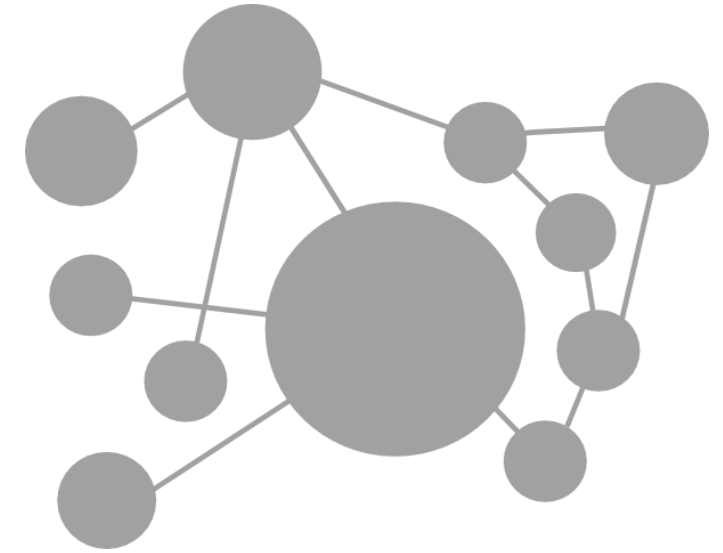
Topologie	4-7-1 mit BIAS
Transferfunktion	Sigmoid
Lernregel	R-Prop

Endgültiges Netz nochmals mit 200.000  
Zyklen trainiert und getestet:

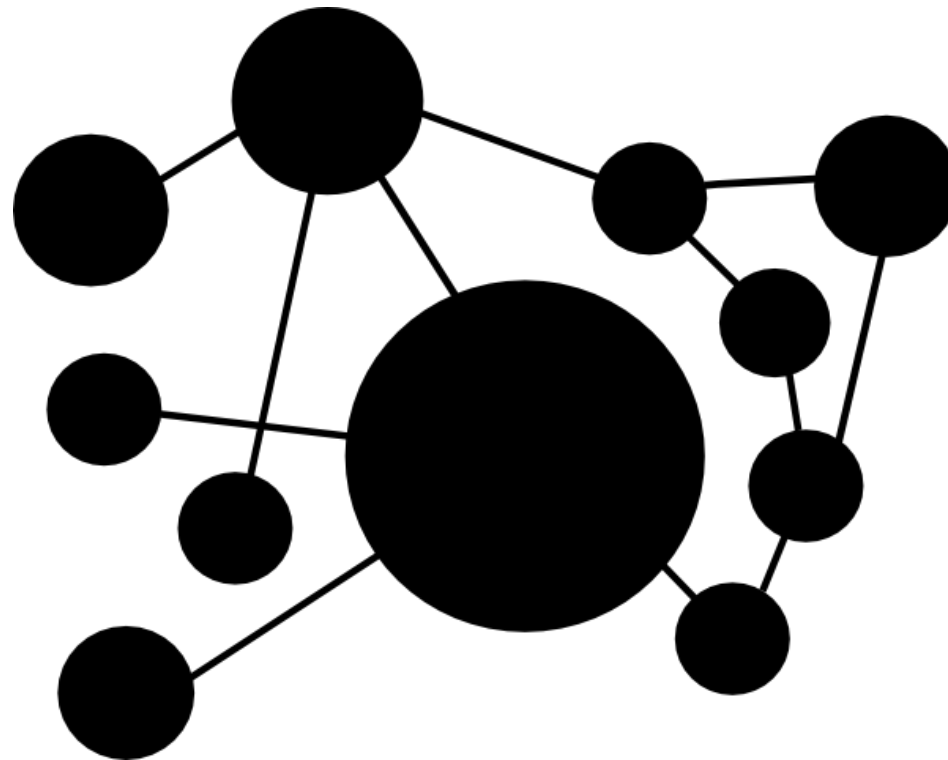
- MSE-Training:  $6,672 \cdot 10^{-5}$
- MSE-Test:  $2,820 \cdot 10^{-4}$

# Inhaltsverzeichnis

- I. Motivation
- II. Konzeption der Anwendung
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes
- IV. Umsetzung der Anwendung
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes
- VI. Livedemonstration der Anwendung**
- VII. Analyse
- VIII. Fazit

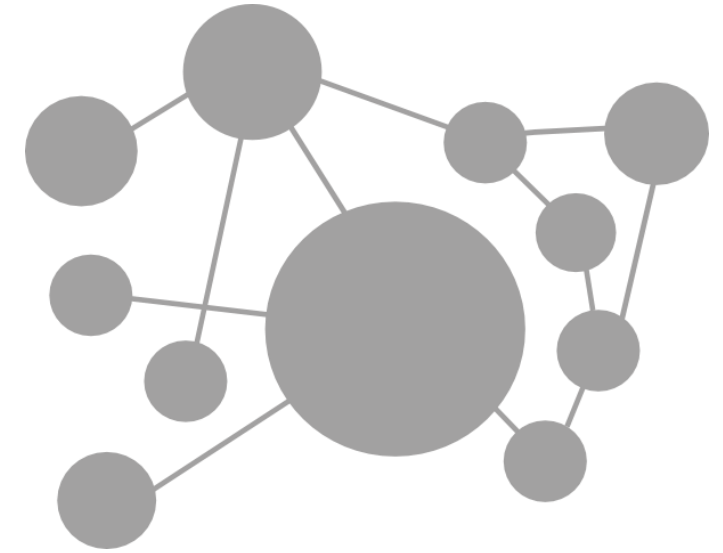


# VII. Livedemonstration der Anwendung



# Inhaltsverzeichnis

- I. Motivation
- II. Konzeption der Anwendung
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes
- IV. Umsetzung der Anwendung
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes
- VI. Livedemonstration der Anwendung
- VII. Analyse**
- VIII. Fazit



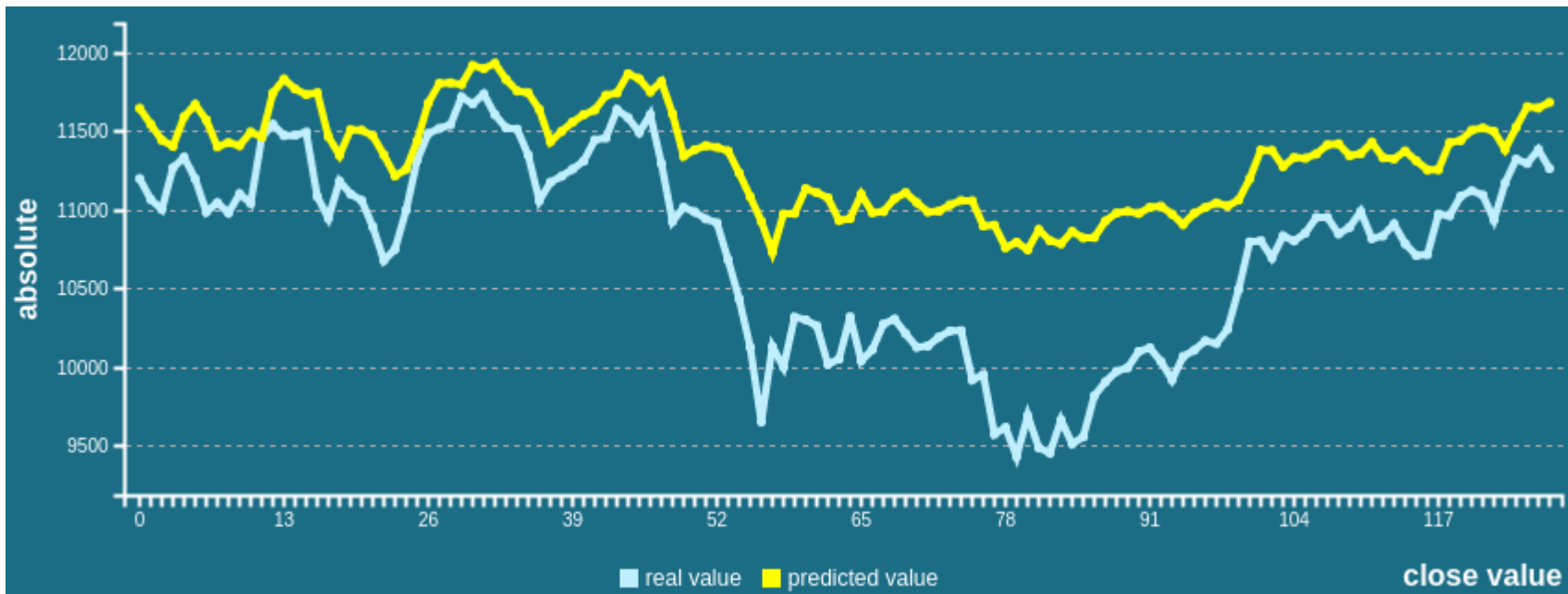


# VIII. Analyse

- Börsencrash 2008
  - Zeitraum vom 01.06.2015 bis zum 01.12.2015
- Fukushima 2011 (nur Nikkei)
  - Zeitraum vom 01.01.2015 bis zum 01.06.2015
- Die letzte Jahreshälfte
  - Zeitraum vom 01.06.2016 bis zum 01.12.2015

# VIII. Analyse

## ■ Letztes halbes Jahr - DAX



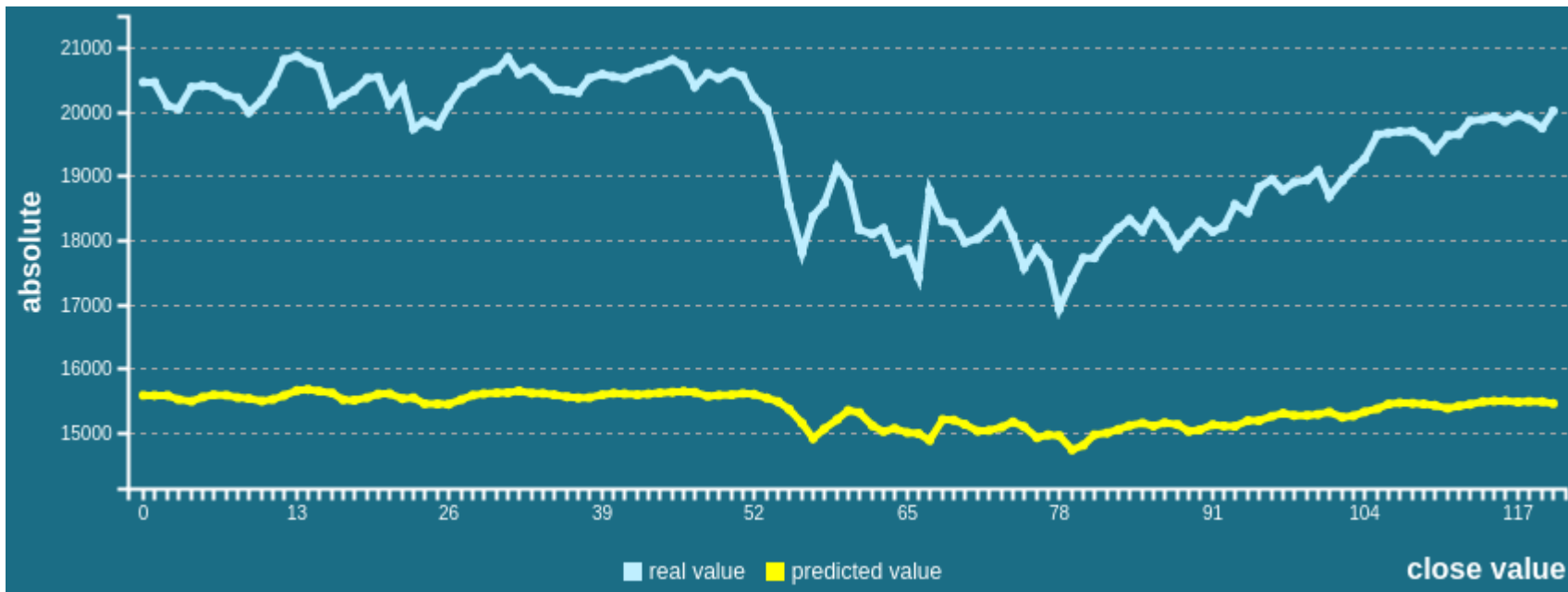
# VIII. Analyse

## ■ Letztes halbes Jahr – Dow Jones



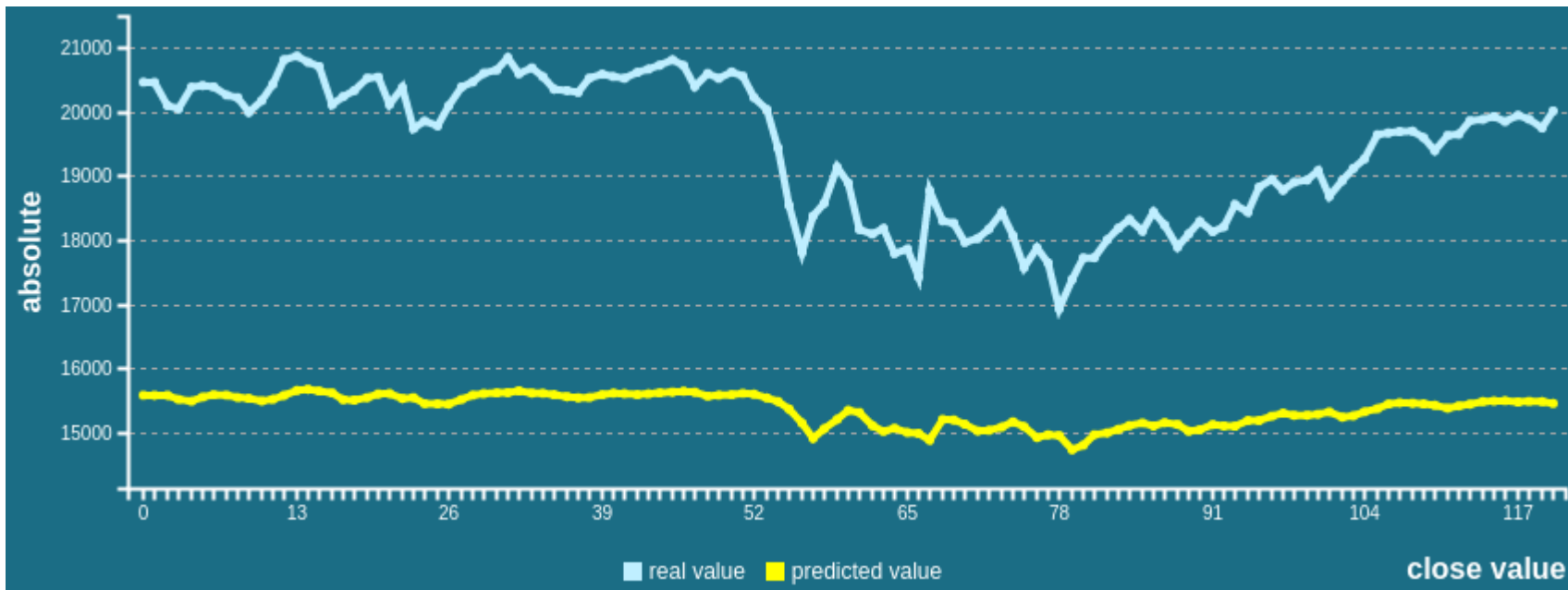
# VIII. Analyse

## ■ Letztes halbes Jahr – Nikkei 225



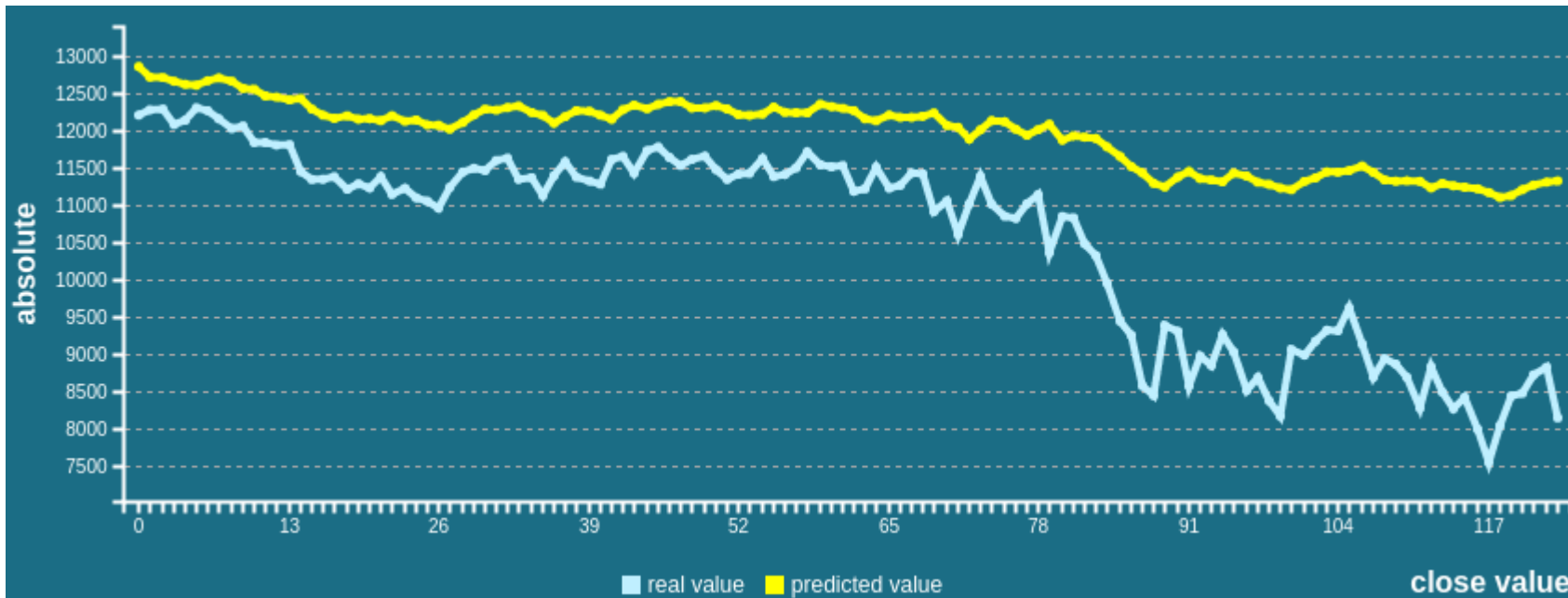
# VIII. Analyse

## ■ Börsencrash 2008 - DAX



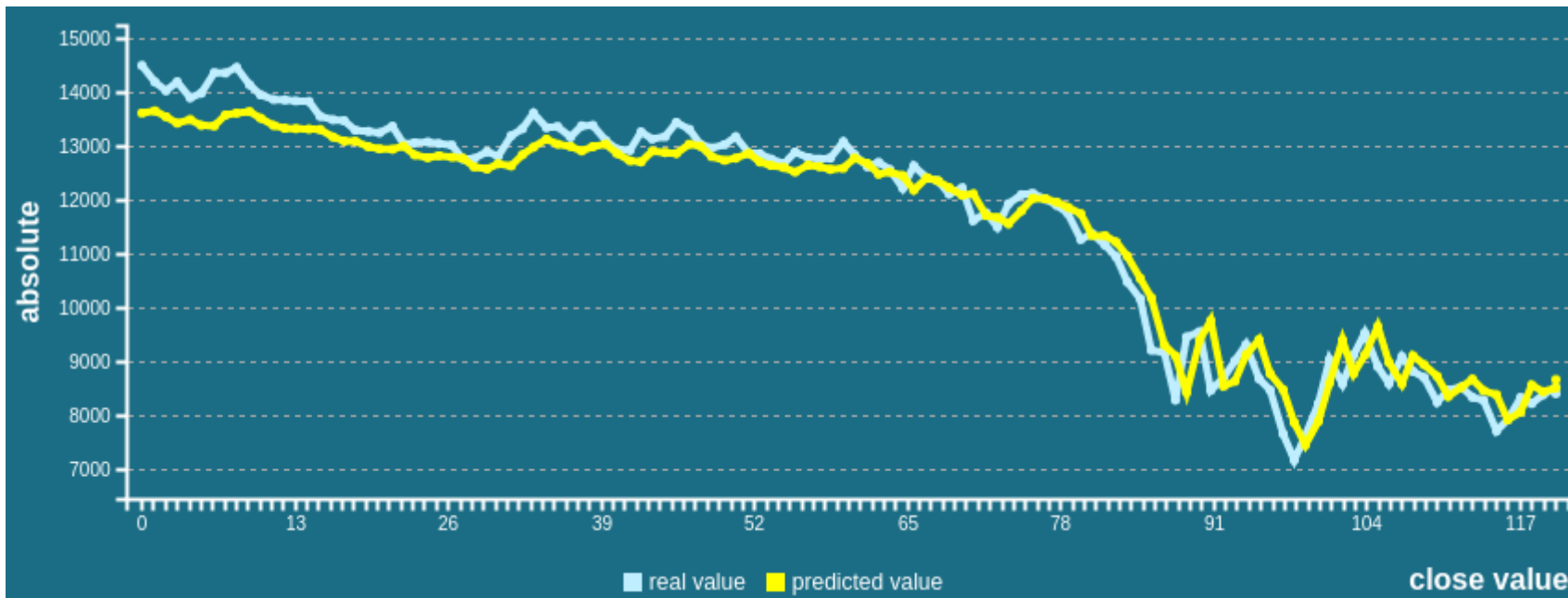
# VIII. Analyse

## ■ Börsencrash 2008 – Dow Jones



# VIII. Analyse

## ■ Börsencrash 2008 – Nikkei 225



# VIII. Analyse

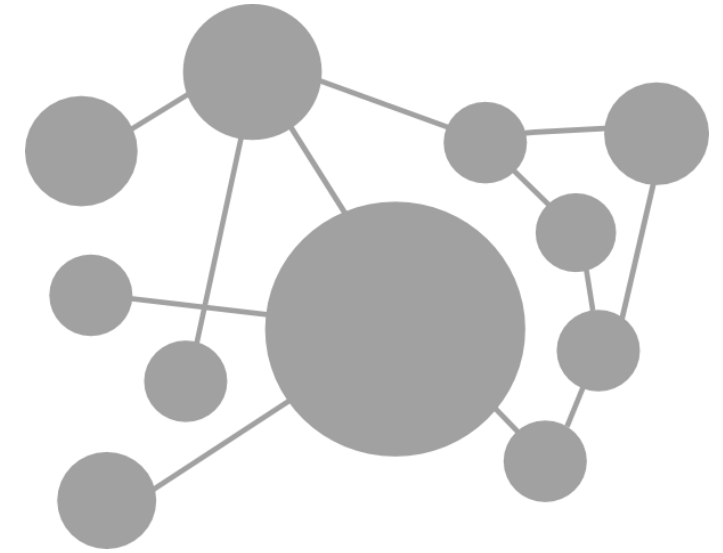
## ■ Fukushima 2011– Nikkei 225





# Inhaltsverzeichnis

- I. Motivation
- II. Konzeption der Anwendung
- III. Konzeption des künstlichen neuronalen Netzes
- IV. Umsetzung der Anwendung
- V. Umsetzung des künstlichen neuronalen Netzes
- VI. Livedemonstration der Anwendung
- VII. Analyse
- VIII. Fazit**

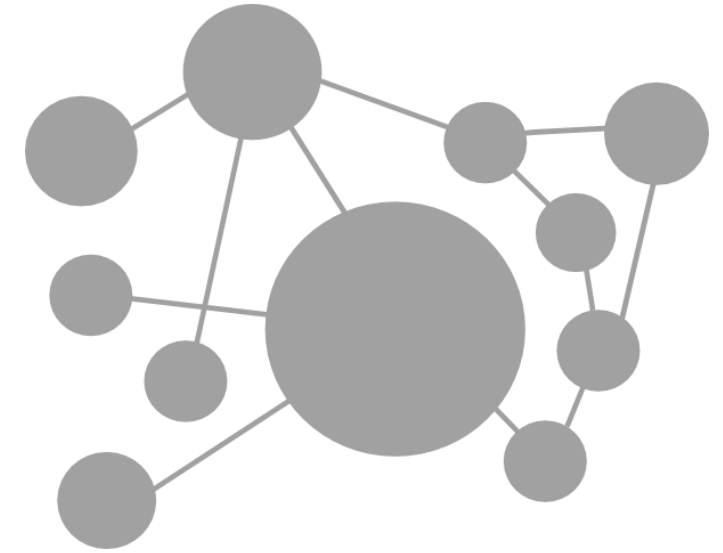


# IX. Fazit

- Die Prognose von Börsenkursen ist prinzipiell möglich.
- Basismodell arbeitet nur mit linearen Zusammenhängen.
  - Abgeschottete Welt
  - Erweiterung durch nichtlineare Zusammenhänge möglich:
    - Leitzins
    - Weltereignisse
    - Kurse anderer Börsen
- Prognosen mit neuronalen Netzen sind umstritten:
  - Befürworter: nichtlineare Muster erkennen wertvoll.
  - Kritiker: KNN denkt wie ein Mensch ➡ macht die gleichen Fehler.

# IX. Fazit

- KNN als Ergänzung sinnvoll, nicht als alleiniges Prognoseinstrument.
- Anwendungen dieser Art bereits zahlreich auf dem Markt vorhanden:
  - Neuroshell Trader
  - Altredo
  - ...



**Präsentationsende...**  
**...Fragen & Diskussion**