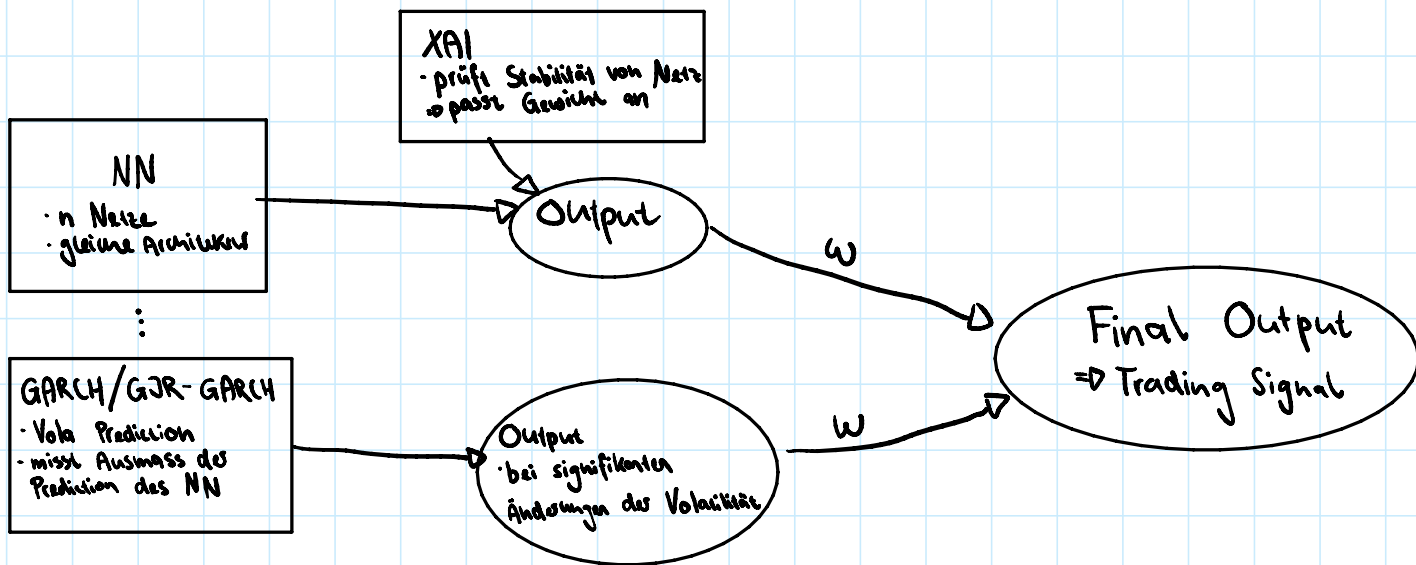


Konzept

Mittwoch, 14. April 2021

14:14



Theorie:

- XAI ergänzen

Methodology:

- Overview mit Bild und Text:
 - o Find optimal FF NN
 - o Black Box => XAI
 - o Prediction
 - o Trading
- Feed forward NN:
 - o Netzwerk Architektur:
 - Vergleich der verschiedenen Netze
 - Gibt es Zusammenhang zwischen MSE und Sharpe?
 - MSE (keine, inverse Korrelation zwischen in-sample und out-of-sample etc.)
 - MSE und Sharpe
 - Mehrwert von komplexer Architektur minimal
 - o Window sample splits:
 - Referenzieren auf Paper (Referenz auf NN in financial trading)
 - o Fazit:
 - Black box
- XAI:
 - o LPD und Schlüsse daraus
- Prediction:
 - o Beste NN-Architektur mit 100 Realizationen brauchen für Predictions von Log Returns
 - o Prediction überprüfen (MSE, DM)
- Trading:
 - o Overview
 - o Grafische Übersicht mit Faktoren, die in Trading Signale reinfließen
 - o Faktoren:
 - Predictions
 - XAI LPD
 - GARCH vola prediction
 - o Bonus:
 - XAI nutzen als Gesamtgewichtung