

Seminar Empirical Analysis of Stock Markets

durchgeführt von Prof. Dr. S. Perminov & Mr. K. Andreyev (Beneficious Investment Management)

Das Seminar findet im zweiwöchentlichen Rhythmus immer mittwochs von **08:00 - 10:00 Uhr** (HS 1231 KGI) an folgenden Terminen statt:

26.04.2017 – 10.05.2017 – 24.05.2017 – 21.06.2017 – 05.07.2017 – 19.07.2017.

Für die Teilnahme am Seminar und die erfolgreich erbrachten Prüfungsleistungen können **6 ECTS-Punkte** angerechnet werden.

Das Seminar wird komplett in englischer Sprache abgehalten werden.

Concept

This seminar series is structured as a continuous research project (now offered for the 2nd time). Since a seminar is anticipated to be offered every semester, its design provides flexibility for students in organizing and planning their research. A student can select a financial research topic from a list.

Students are expected to develop and backtest an investment strategy in Quantopian platform. Students are expected to deliver:

- a write-up of the research topic (e.g. a market phenomenon)
- calculations and backtests supporting the write-up, in a form of Quantopian research notebooks and algorithms (compilable and documented code)
- presentation summarizing the research findings.

To have a smooth introduction into a Quantopian environment students are recommended to study tutorials and relevant lectures prepared by Quantopian. As this is a continuous seminar which results in accumulation of both methods and findings, students are advised to as much as possible build on previous research done by other students, including documents, research notebooks, algorithms and project notes. This will facilitate a further knowledge accumulation. Students will communicate online and offline with the project supervisors (Beneficious Investment Management) and other students on project-related issues.

Anmeldung

Die Teilnehmerzahl für dieses Seminar ist beschränkt. Interessierte Studierende werden daher gebeten, sich bis

spätestens Freitag, den 31.03.2017

per Mail an roberta.janosi@finance.uni-freiburg.de anzumelden. Bitte geben Sie dabei Ihren Studiengang und Ihre Semesterzahl an und fügen eine aktuelle Leistungsübersicht (Kreditpunkteauszug) bei.

Das Seminar kann von Studierenden der Studiengänge M.Sc. Economics, M.Sc. VWL, B.Sc. und M.Sc. Mathematik belegt werden.

Im *M.Sc. Economics* kann das Seminar in der Profillinie "*Finance*" angerechnet werden.

Im *M.Sc. VWL* kann das Seminar im Spezialisierungsbereich *Accounting, Finance, and Taxation* (PO 2014, gültig ab WS 2014/2015) angerechnet werden.

Studierende im B.Sc. oder M.Sc. Mathematik (dort insbesondere in der Profillinie "Finanzmathematik") können sich das Seminar als fachfremdes wirtschaftswissenschaftliches Wahlmodul anrechnen lassen.

Notwendige Vorkenntnisse

Für die technischen Analysen sowie die Erstellung von Grafiken für die Abschlusspräsentation sollten die Teilnehmer Grundkenntnisse in dafür geeigneten Computerprogrammen (Excel, R oder ähnliches) besitzen.

Ferner wird eine gewisse Vertrautheit im Umgang mit Finanzprodukten erwartet, wie man sie z.B. im Rahmen der Vorlesung [Futures and Options](#) erwerben kann.