



unimc
UNIVERSITÀ DI MACERATA



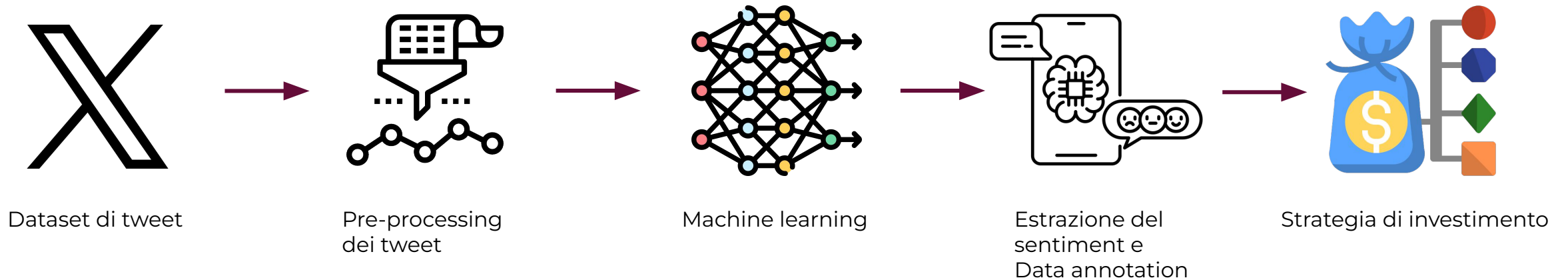
Week 3 – Lezione 3

Introduzione al machine learning e applicazioni in finanza

Modelli previsionali

Prof. Andrea Bucci

Sentiment analysis



Modelli previsionali e strategie di investimento

Il machine learning viene utilizzato indistintamente in funzioni di back-office e in funzioni di front-office nelle banche di investimento.

La maggior parte delle applicazioni **back-office** in finanza di Machine learning riguarda:

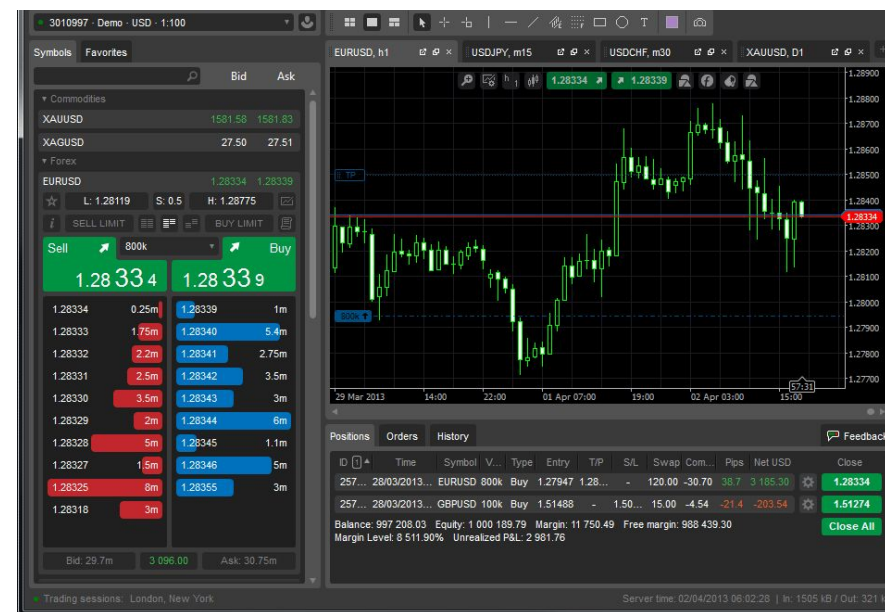
1. Previsione di prezzi/rendimenti/volatilità
2. Costruzione di portafogli
3. Trading tramite algoritmi
4. Costruzione di derivati
5. Merito creditizio

Perché ora?

Si è passati da questo...



... a questo!



Machine learning in finanza

Previsione di prezzi/rendimenti/volatilità

- L'obiettivo è prevedere il prezzo, il rendimento o la volatilità futuri utilizzando l'informazione passata
- L'utilizzo di tecniche di machine learning permette di analizzare caratteristiche non analizzabili in precedenza, ad es. non linearità
- Alcuni algoritmi di machine learning stanno prevedendo meglio dei modelli tradizionali.
- Specialmente nella previsione di volatilità

