

## **TEKX04-22-05**

### **Problem**

Teknologin har möjliggjort att arbeta tvärvetenskapligt med finansiell matematik och IT. I bakgrund av den ökade användningen av algoritmhandel undersöks huruvida algoritmhandel kan medföra överavkastning eller ej genom att använda oss av statistiska modeller och teorier.

### **Syfte**

Genom att använda oss utav statistiska modeller och riskbedömning, analysera trading algoritmer vid börshandel för att undersöka om dessa kan bidra till en överavkastning eller inte och risk för att bedöma riskjusterad avkastning.

### **Metod**

Använder oss utav backtesting, Value at Risk beräkning och simulering vid undersökning. Programkod för olika algoritmer.

Undersöka vad ökad andel robohandel kan leda till då underliggande tillgångens värde inte tas hänsyn till utan rörelse i pris (bubblor som spricker och resulterar i lågkonjunktur).

Ta kontakt med Markov Capital (företag som arbetar med liknande)

### **Förvalda medlemmar**

Oscar Adamsson

Oskar Block

William Wester