



机器学习与量化投资

Jian Li

Tsinghua University

Time: 9:30-10:30 (Time in Beijing)
13:30-14:30 (Time in Auckland)

July 2, 2021 (Friday)

Venue: B1-501, Main Building

Abstract: 当代机器学习，尤其是深度学习的突破性进展已经给多个行业带来了巨大变革。将当代机器学习的工具与思想应用到量化投资领域是一个吸引人的课题，并得到了业界和学术界的广泛关注。量化投资是否可以归结为一个预测价格涨跌的监督学习问题？是否将传统的线性预测模型替换为最新得深度学习模型，我们就实现了机器学习与量化投资的结合？当代机器学习的工具到底能在哪些环节提高量化投资的能力与效率？在本次交流中我将以机器学习研究者的视角和大家对以上的问题进行交流，并分享我们团队近几年的思考和实践。

Speaker Bio: 李建，清华大学交叉信息研究院长聘副教授，博士生导师。他在中山大学取得的学士学位和复旦大学取得的硕士学位，马里兰大学博士毕业。他的研究兴趣主要包括算法设计与分析，机器学习，数据库，金融科技。他已经在主流国际会议和杂志上发表了70余篇论文等，并获得了VLDB 2009 和 ESA 2010 的最佳论文奖，ICDT2017最佳新人奖，清华221基础研究青年人才支持计划，教育部新世纪人才支持计划，国家自然科学基金优秀青年基金。他主持并参与了多项科研项目，包括自然科学基金青年基金，面上项目，中以国际合作项目，青年973计划等。

Chengdu Algorithms and Logic Seminar is a series of online seminars organized by School of Computer Science and Engineering, University of Electronic Science and Technology of China, and School of Computer Science, University of Auckland that aims to promote collaborations in a broad range of topics in algorithms and logic.

Organizers: Bakhadyr Khossainov, Jiamou Liu, and Mingyu Xiao

Email: myxiao@gmail.com (Mingyu Xiao)