



ÉCONOMIE, FINANCE, CONTRÔLE & DROIT

Hans-Jörg von Mettenheim

Professeur Titulaire en Finance Quantitative & Gestion des Risques ? Responsable de l'Axe de recherche "Finance"

Contact

Email : hj.von-mettenheim@ipag.fr

Contact [LinkedIn](#)

Phone : +33 1 5363 3600

Campus : Paris

Biographie

Hans-Jörg von Mettenheim est Professeur et Directeur de la Chaire de Finance Quantitative et de Gestion des Risques à l'IPAG Business School Paris. Il est titulaire d'un Doctorat en Économie (summa cum laude) de l'Université Leibniz de Hanovre, en Allemagne. Il a publié dans des revues à comité de lecture et des conférences des systèmes d'information éminents sur des sujets aussi divers que les stratégies de trading quantitatif, la prévision et la modélisation de séries chronologiques, l'intelligence artificielle, en particulier les réseaux de neurones artificiels, et l'économie de l'énergie. Il est Co-rédacteur-en-Chef du *Journal of Forecasting*, secrétaire général et membre fondateur de la *Forecasting Financial Markets Association*.

Éducation

2013 : Évaluation réussie du poste de professeur

2009 : Dr. rer. pol. (équivalent Doctorat). Dissertation Les Réseaux de Neurones Avancées : Finance, Prévision, et Autres Applications

2003 : Diplôme (équivalent MBA) en Économie. Thèse : Développement de la Parallélisation à Gros Grains pour le Neurosimulateur FAUN 1.0 et Applications à la Prévision des Taux de Change

Teaching Areas

- Gestion d'actifs
 - Gestion des risques financiers
 - Gestion financière
-

Research Areas

- Systèmes d'aide à la décision en gestion et en affaires
 - Intelligence artificielle appliquée à la finance et à l'investissement
 - Apprentissage automatique basé sur les réseaux de neurones artificiels
 - Modélisation complexe, dynamique et non linéaire
 - Systèmes de trading algorithmique
 - Calcul haute performance
-

Professional experiences

2010-2016 : Professeur de Systèmes d'Aide à la Décision, École d'Économie (Université Leibniz de Hanovre)

2013-2014 : Administrateur des Professeurs Ordinaires de Macroéconomie, Marchés Financiers et Professeur Ordinaire de Banque et Finance (Université Leibniz de Hanovre)

Selected publications

- Goutte S., Klotzner K., Le H.-V., von Mettenheim H.-J. (2024). Forecasting photovoltaic production with neural networks and weather features. *Energy Economics*, 139. <https://doi.org/10.1016/j.eneco.2024.107884>
- Karathanasopoulos, A., Lo, C. C., Sovan, M., Osman, M., von Mettenheim, H. J., & Skander, S. (2024). A multi-objective optimization metaheuristic hybrid technique for forecasting the electricity consumption of the UAE: A grey wolf approach. *Journal of Forecasting*, Volume 44 (Issue 1), 242-252. <https://doi.org/10.1002/for.3187>
- Fogel, P., Geissler, C., J. Von Mettenheim, H., & Luta, G. (2023). Applying non-negative tensor factorization to centered data. *Bankers, Markets & Investors*, 174 (3), 2-13. <https://www.cairn.info/revue-bankersmarkets-et-investors-2023-3-page-2.htm>
- Goutte, S., Grosse, R., Le, H. V., Liu, F., & Von Mettenheim, H. J. (2023). Portfolio management with ESG news sentiment. *Bankers, Markets & Investors*, 1-2 (172-173), 72-84. <https://www.cairn.info/revue-bankersmarkets-et-investors-2023-1-page-72.htm>
- Goutte, S., Le, H. V., Liu, F., & Von Mettenheim, H. J. (2023). Deep learning and technical analysis in cryptocurrency market. *Finance Research Letters*, 54, 103809. <https://doi.org/10.1016/j.frl.2023.103809>
- Le, V. H., von Mettenheim, H. J., Goutte, S., & Liu, F. (2022). News-based sentiment: Can it explain market performance before and after the Russia-Ukraine conflict?. *The Journal of Risk Finance* (ahead-of-print).
- Tholl, J., Schwarzbach, C., Pittalis, S., & von Mettenheim, H. J. (2020). Bank funding and the recent political development in Italy: What about redenomination risk?. *International Review of Law and Economics*, 64, 105932.
- Nguyen, D. K., Sensoy, A., Vo, D. T., & von Mettenheim, H. J. (2021). Does short-term technical trading exist in the Vietnamese stock market? *Borsa Istanbul Review*, 21(1), 23-35.
- Gleue, C., Eilers, D., von Mettenheim, H. J., & Breitner, M. H. (2019). Decision support for the automotive industry: Forecasting residual values using artificial neural networks. *Business & Information Systems Engineering*, 61, 385-397.
- Dress, K., Lessmann, S., & von Mettenheim, H. J. (2018). Residual value forecasting using asymmetric cost functions. *International Journal of Forecasting*, 34(4), 551-565.
- Government Bond Yield Spreads in the Eurozone: Empirical Evidence from Better Days, to appear in *Quantitative Finance*, 2018 (with Tobias Basse, Christoph Wegener, Frederik Kunze).
- Liu, F., Pantelous, A. A., & von Mettenheim, H. J. (2018). Forecasting and trading high frequency volatility on large indices. *Quantitative Finance*, 18(5), 737-748.
- Gleue, C., Eilers, D., von Mettenheim, H. J., & Breitner, M. H. (2017). Decision support for the automotive industry: forecasting residual values using artificial neural networks.
- Wegener, C., Basse, T., Kunze, F., & von Mettenheim, H. J. (2016). Oil prices and sovereign credit risk of oil-producing countries: an empirical investigation. *Quantitative Finance*, 16(12), 1961-1968.
- Wegener, C., von Spreckelsen, C., Basse, T., & von Mettenheim, H. J. (2016). Forecasting government bond yields with neural networks considering cointegration. *Journal of Forecasting*, 35(1), 86-92.
- Von Spreckelsen, C., Von Mettenheim, H. J., & Breitner, M. H. (2014). Steps towards a high-frequency financial decision support system to pricing options on currency futures with neural networks. *International Journal of Applied Decision Sciences*, 7(3), 223-238.
- Von Spreckelsen, C., von Mettenheim, H. J., & Breitner, M. H. (2014). Real-time pricing and hedging of options on currency futures with artificial neural networks. *Journal of Forecasting*, 33(6), 419-432.
-