

1. はじめに
2. 進捗報告
3. システム概要
4. 実行結果
5. おわりに

# 市場間分析を活用した 高頻度データに対するパラメータ選択による 最適なストラテジー構築

木下大輔

蒲田 涼馬 (Ryouma Gamada)  
u020010@st.pu-toyama.ac.jp

富山県立大学 情報システム工学科 3 年

January 27, 2023

- 1. はじめに
- 2. 進捗報告
- 3. システム概要
- 4. 実行結果
- 5. おわりに

## 背景

1996 年の外国為替証金取引の完全自由化により FX 取引が誕生してから、年々金融市場の規模は拡大している。

さらにコンピュータの性能向上によりそれらを駆使することで自動的にルールに従いトレードを行うといったようなシステムトレードが行われている。

最近では人工知能を導入した予測などの研究も行われている。

## 目的

市場に対しての分析を行うとともに、他市場が為替市場に与える影響を取引の際に考慮することで市場内の要因から得られる分析結果のみならず、そこからでは予測できないような変動にも対応ができる手法を提案。

## 2. 進捗

3/6

### 進捗

- ・ 物理的環境を整えた
- ・ 木下さんの自動売買システムの動かし方を教えていただいた
- ・ 実際に動かしてみた
- ・ 大谷さんと木下さんの卒論を読む (途中)

1. はじめに
2. 進捗報告
3. システム概要
4. 実行結果
5. おわりに

### 3. システム概要

4/6

#### システム概要

1. データ取得
2. インジケータのパラメータ最適化
3. 円ドル為替市場に対するグレンジャー因果性検定
4. 最適なパラメータ, グレンジャー因果性を用いての売買選択
5. 最適ルールでの自動売買

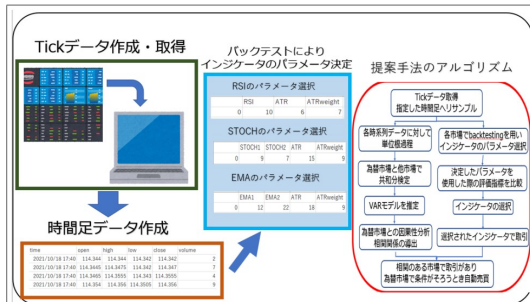


図 1: 手法の流れ (木下さん卒論)

## 4. 実行結果

5/6

- はじめに
- 進捗報告
- システム概要
- 実行結果
- おわりに

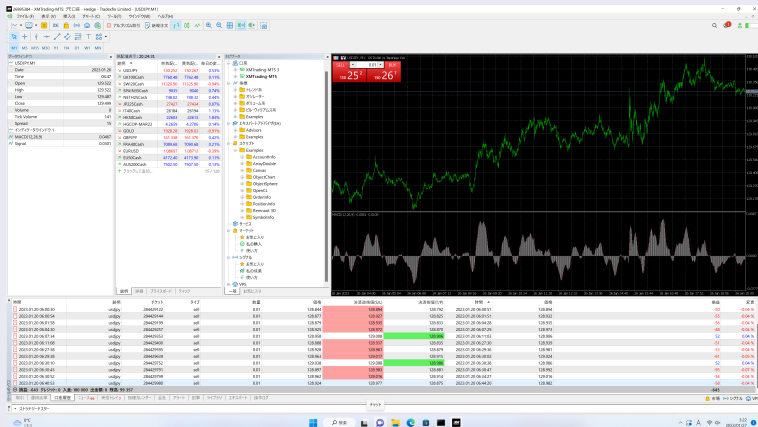


図 2: 実行結果

## 5. 終わりに

6/6

### まとめ

- ・環境を整えた.
- ・動かし方を教えてもらって実際にやってみた.

### 今後

- ・卒論を全然読めていないので熟読する.
- ・FX についての知識が皆無であるため勉強する.
- ・プログラムの解読.
- ・FX 用の PC でプログラム実行中に Wifi 接続が切れてしまうことが度々あるので何とかする.
  - ・一度しか動かしていないので何とも言えないが、負けているので改善する必要がある.