

はじめに
現在の状況
終わりに

市場環境に追従するための ロジスティック回帰を適用した 最適インジケータの選択

木下大輔

富山県立大学 電子情報工学科

July 30, 2021

はじめに

はじめに

経済活動の活発化に伴い、金融市場の規模は拡大し金融市場のメカニズムに関する研究の重要性が増している。しかし、金融市場は複雑な要因がからみあっており全容を明らかにすることは困難である。

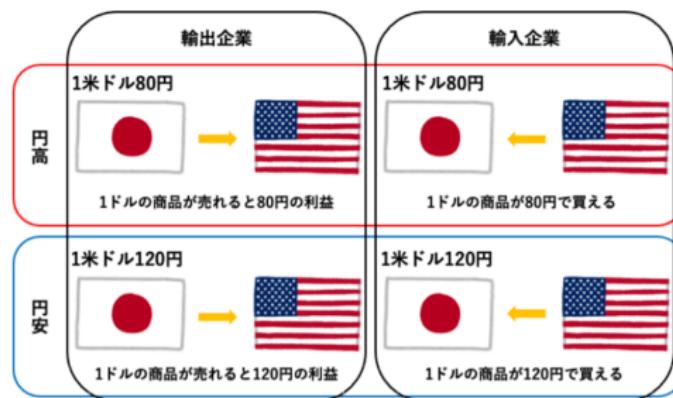


図 1: 円高円安と企業の関係

分析手法

- 市場から得られる情報をもとに、分析を行い市場の傾向を把握することで今後の動きを予測する手法。
- ソーシャルメディアを実世界の射影と捉え、それらから得られる情報から市場の観測や予測を行う手法。

進捗状況

4/8

進捗状況

- インジケータの追加
- 使用する分析手法の勉強

はじめに
現在の状況
終わりに

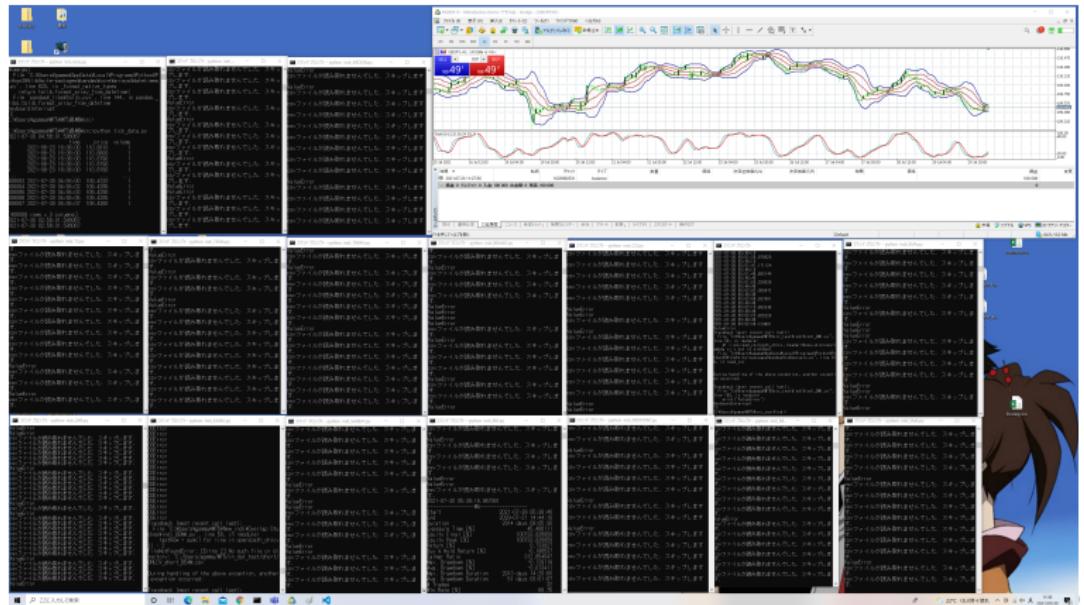
インジケータの追加

5/8

現在

追加する分のインジケータのプログラムが作成できたので実際に増やしたインジケータプログラムを稼働してみた。

はじめに
現在の状況
終わりに



結果

- インジケータプログラムの数が少ない時は正常に稼働していた。
- 数が増えるごとに csv ファイルの読み取りが出来ない状況が増えていった。
- 改善が必要。

はじめに
現在の状況
終わりに

ロジスティック回帰分析

はじめに
現在の状況
終わりに

システムが完成したら、下のデータにロジスティック回帰分析を用いて、最適なインジケータの選択を使用と考えているので、どのようなデータに対してこの分析手法は使えるのか。またどのような結果が得られるのかという基礎的な部分の勉強を行った。

	評価指標1	評価指標2	評価指標3	評価指標4	評価指標5	評価指標6	評価指標7	評価指標8	評価指標9	評価指標10	評価指標11	評価指標12	評価指標13	評価指標14
インジ	13018.324	11050.314	17862.594	17794.483	14695.7238	14428.577	14894.989	15201.599	17382.603	18800.1021	19282.708	10199.585	18719.144	19732.033
インジ	15691.374	12869.38	12526.886	11028.738	16360.4748	11928.095	18425.887	11771.384	11017.14	12180.2407	13183.144	18037.355	17245.408	19648.615
インジ	11386.412	11775.44	12901.553	19254.969	12539.8039	11884.653	19182.204	14389.948	10437.72	10488.8954	16438.859	15709.064	15822.532	19412.431
インジ	10069.548	12926.354	13399.503	14330.176	18173.9605	14006.493	18770.214	12728.359	13741.654	11235.9088	10459.825	19708.464	14160.163	16175.389
インジ	18006.257	14947	12124.197	18118.528	19125.454	10987.828	18017.064	18044.393	13157.874	16235.9122	13555.864	15175.334	19711.979	11771.783
インジ	15153.945	10529.739	12109.333	13188.802	12261.2494	16732.773	12235.827	18998.855	15581.345	14663.1617	11466.189	11983.942	19161.188	14787.74
インジ	19982.754	19549.046	18818.978	18169.587	11429.5501	16607.202	10533.475	10816.449	16527.389	11522.3469	15110.4	13858.146	13211.326	16881.14
インジ	16385.945	11836.012	19533.194	12667.382	10930.0699	13501.282	16739.665	12708.271	17027.168	18733.9021	15674.7	15574.227	11526.888	14818.314
インジ	17415.999	12309.984	19742.328	16075.32	11951.6224	19893.813	18647.162	14577.304	18172.266	16572.1401	19149.237	10950.032	19436.772	12388.035
インジ	15943.702	17524.432	10119.586	16982.948	14716.7661	15744.897	10068.405	14338.172	16178.587	19040.9418	18306.813	11027.479	19349.248	16808.34
インジ	15743.522	16803.123	13758.214	13757.784	10701.4955	13568.567	16945.177	18205.824	11789.929	16462.7172	12063.488	11838.448	19080.419	15166.275
インジ	16535.774	16929.967	18807.501	17572.368	16325.2436	15096.861	11239.171	12250.502	19634.187	14773.1466	12520.125	14031.728	11640.158	15544.199

図 3: 取り出したいデータ例

課題

8/8

まとめ

- インジケータの増加によるエラーへの改善
- 図3のようなデータを取り出せるようにする。
- 分析手法の勉強

はじめに
現在の状況
終わりに