

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

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いるため全容を明らかにすることは困難である。

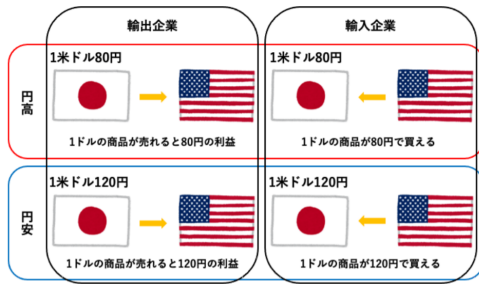


図 1: 円高円安と企業の関係

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

- インジケータの追加
- 使用する分析手法の勉強

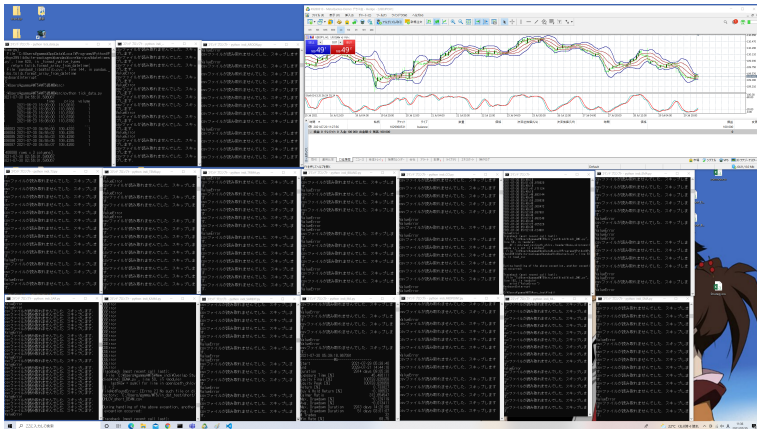
インジケータの追加

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。

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