



1. 本研究について

2. リアルタイム取引のための最新のツイート取得

3. トランプ大統領のツイートをを用いた代替予測

経済に関するオルタナティブ・データを 考慮した金融マーケット予測手法の開発

Development of Financial Market Forecasting Method
Considering Alternative Data on Economy

Itaru Aso

Graduate School of Information Engineering, Toyama Prefectural University
t855001@st.pu-toyama.ac.jp

Toyama Prefectural Univ.



1.1 取り組み

取り組み内容

- 1 リアルタイム取引のための最新のツイート取得
- 2 トランプ大統領のツイートを用いた為替予測

1. 本研究について

2. リアルタイム取引のための最新のツイート取得

3. トランプ大統領のツイートを用いた為替予測



2.1 最新のツイート取得

1. 本研究について

2. リアルタイム
取引のための最新
のツイート取得

3. トランプ大統領
のツイートを
用いた為替予測

Twitter

@realDonaldTrump

ドナルド・トランプ : @realDonaldTrump

ジャスティン・ビーバー : @justinbieber

レディー・ガガ : @ladygaga

ツイート取得

Presidential Harassment!

感情分析

Figure: 1 ツイートのリアルタイム取得

オープンキャンパスで作成したシステムのツイート取得の部分を用いることによって、ツイートのリアルタイム取得を行う

取引のタイミング

最新のツイートが更新されたとき



3.1 分析手法

タイムラグを考慮して予測を行った結果を以下の表に示す

Lag(min)	accuracy(%)
1	50.49
5	48.51
10	62.37
15	61.38
30	60.39
60	41.35

考察

以上の表から 10 分後や 15 分後に市場はツイートの影響を受けていると考えられる

1. 本研究について
2. リアルタイム取引のための最新のツイート取得
3. トランプ大統領のツイートをを用いた為替予測



3.4 今後の展望

課題

- 1 テクニカル指標を考慮する
- 2 文書分類によるカテゴリー分け
- 3 クラスタリング手法の改善

1. 本研究について

2. リアルタイム
取引のための最新
のツイート取得

3. トランプ大統領
のツイートを
用いた為替予測