

金融高頻度データに対する時系列モデルを適用した パラメータ選択による最適なストラテジー構築

1815031 木下大輔

情報基盤工学講座 指導教員 奥原浩之

要約

金融市場の拡大と共に市場のメカニズムに関する研究が大変重要になっている.しかし金融市場における値動きは様々な要因が考えられ,複雑な動きを見せるため予測することは大変困難である.本研究の目的は予測が困難な金融市場の動きをTickデータと複数のインジケータを用いることで金融市場の動きを予測することにより、最適な取引を行うことである.

キーワード:

高頻度データ,インジケータ,ストラテジー,時系列モデル

1 はじめに

1996年の外国為替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.現在では多くのトレーダーが、コンピュータを駆使することで自動的にルールに従い取引をするシステムトレードを導入して機械的に取引を行う投資家が増加している.また昨今のAIブームから人工知能を導入することで価格の予測、戦略を獲得するという研究もおこなわれている.

投資を行う上で、このような金融市場のメカニズムを利用して判断することが一般的である.従来の投資の判断基準として用いられているのが金融市場の要因のみによって得られた分析結果である.そこで用いられる分析は、過去の市場の動きから指標を算出して未来の市場の動向を予測するようなものである.

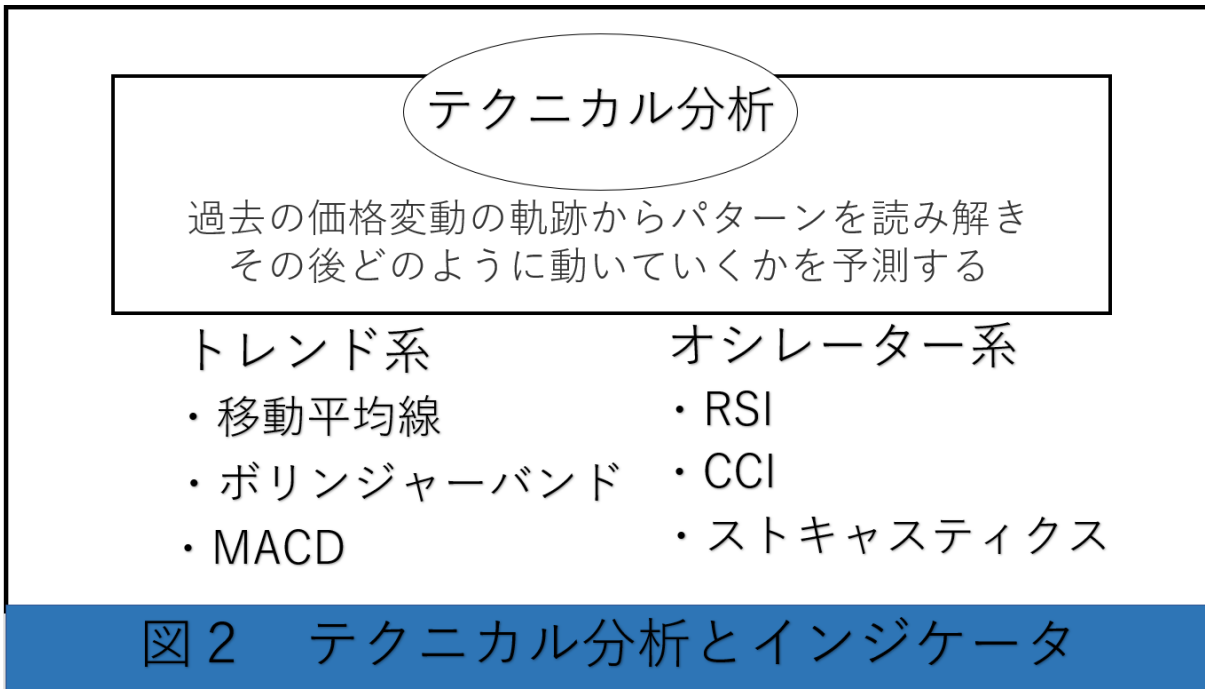
従来の為替予測手法では、指標を算出するために使用する市場データは、現在から数年遡った過去の期間のデータを使用することが多かった.そのことにより、そこで算出した指標が現在の市場の動きに合わない部分があり問題点が発生することになる.

本研究では,リアルタイムで取得したTickデータを使用して,複数のインジケータによってテクニカル分析を行うことで過去の価格や出来高などの要素から未来の価格を予測する.それらの予測された値を比較し自動的に取引に用いる手法を選択する.また事前に使用するTickデータに対してノイズ除去を行うことでより正確に金融市場を分析する

要があると考えられる.また、投資家本人がチャートと指標を見て投資判断を行うために、不確定な要素が多いといった問題点もある.テクニカル分析で用いられる情報としては、「現在の相場のトレンド傾向」、「現在のトレンドの強さ」、「相場が上昇や下降時の転換点」、「値頃感や相場の変動幅」最近では、時系列データの予測が得意であるニューラルネットワークや機械学習によって大規模なデータから分析を行ったり、最適なテクニカル指標を算出して効果的な予測を行うような研究が行われている.

インジケータとは、為替レートの時系列情報を様々な計算で加工して売買の判定に利用する指標のことを指す.インジケータを使用することにより、人間が見るだけではわからない情報が発見できる時がある.特定期間内の平均レートや相場の方向感を数値化したデータなどが例として挙げられる.

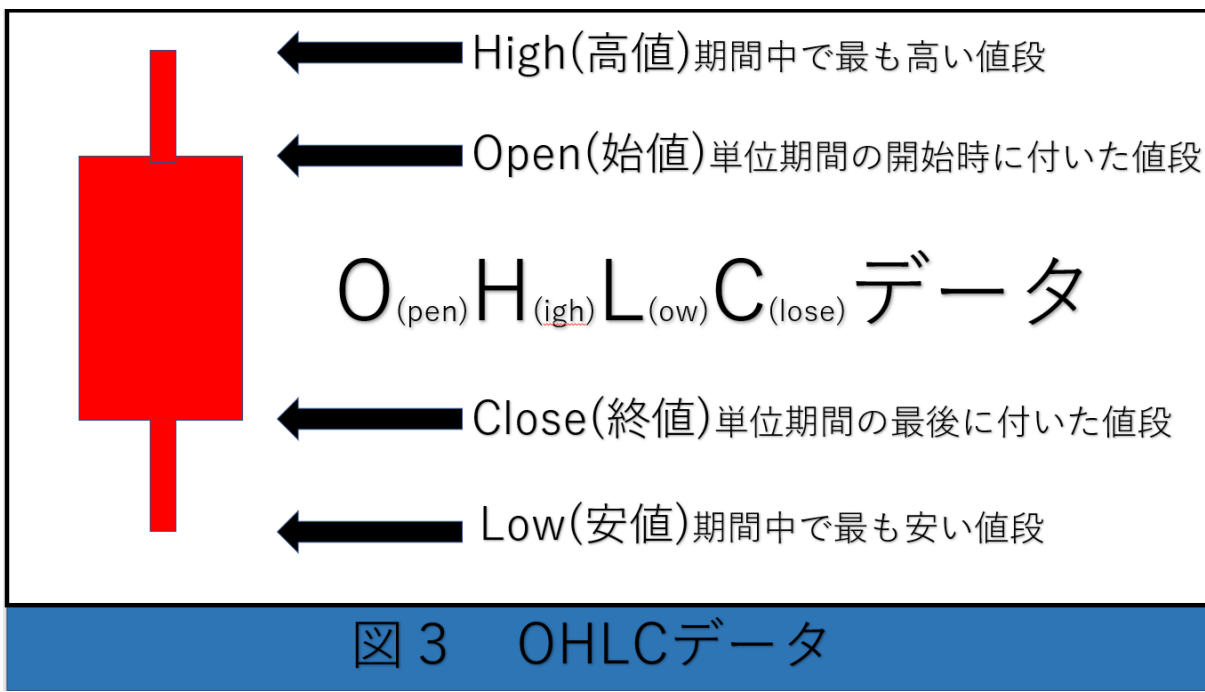
インジケータにはオシレーター系とトレンド系の二つある(図2参照).為替レートは上がり過ぎると下がる,下がり過ぎると上がる性質がある.オシレーター系のインジケータはこの性質を活かし、為替レートが上がり過ぎと下がり過ぎを数値化,グラフ化するものである.トレンド系のインジケータは現在の相場が上がりやすい傾向であるか下がりやすい傾向であるかグラフ化し、視覚的にわかりやすくするものである.



2.3 ストラテジーテスターにおけるバックテストと最適化

今回インジケータのパラメータが最適になるよう検証するため,pythonライブラリであるbacktestingを使用する.backtestingでは過去の相場を用いて,指定した条件に基き売買をすることでシミュレーションをすることが可能である.バックテストは主にシステムトレードの分野で使われることが多い言葉だが,裁量トレードの分野でも売買ルールの有効性を確認するためにバックテストが行われることがある.

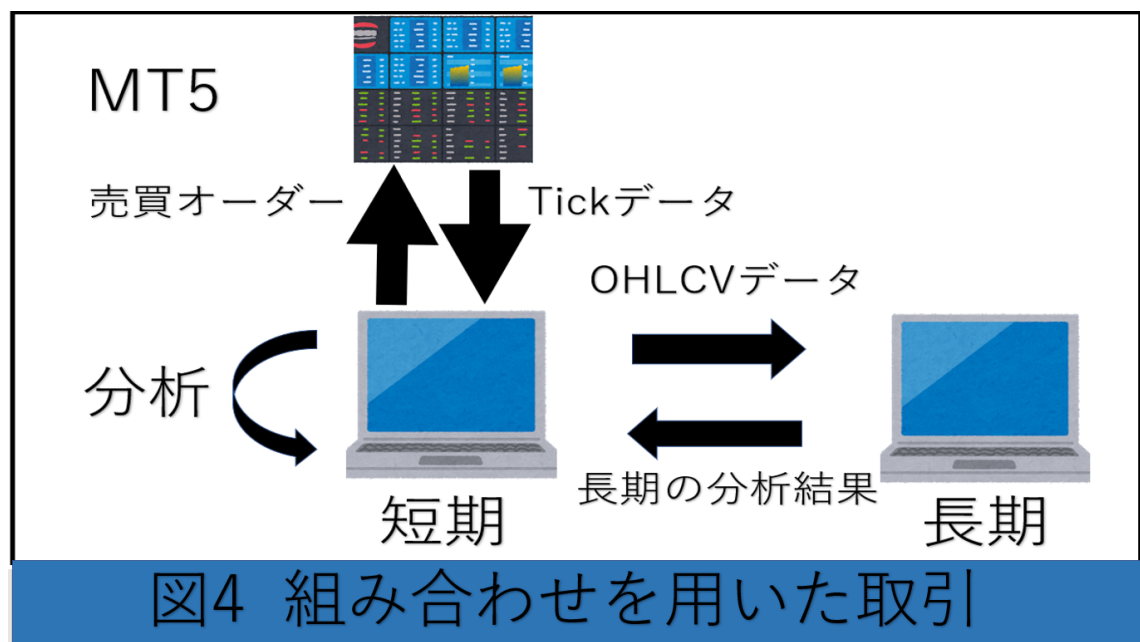
今回の実験ではbacktestingを使用することでインジケータにおけるパラメータのチューニングを行い、それらのパラメータを使用してbacktestingすることで評価基準に従い使用するインジケータを使用することで最適化をする.backtestingは用意した時間足のOHLCVデータを使用することで利用することができる.



3 インジケータの選択

3.1 長期・短期の組み合わせ

今回の自動売買においては長期と短期の時間足を組み合わせた取引を行う.二台のPCを使用することでそれぞれ指定した時間足のOHLCVデータに対してテクニカルインジケータを使用することで短期と長期で市場を分析した違いを把握することができる.これまでの単一の時間足に対してのインジケータでの分析では短い時間足の時に騙しに入ってしまうことなどがあった.短期と長期を組み合わせることにより短期では売り買いのタイミングであっても、長期的に市場を見た場合、実際には最適な売り買いのタイミングでないことがある.しかし長期の時間足で売り買いをしている最中でしか、短期の時間足で売り買いを出来ないように設定することで長期的に見た場合と短期的に見た場合の両方の最適なタイミングで売り買いをすることができるようにする.



3.2 金融時系列の与え方

本研究で使用するTickデータは高頻度データでありリアルタイムに収集するデータであることから、そこに含まれる情報には少なくないノイズが含まれている.観測されたデータを使用する際、それらからノイズを除去して真のデータを抽出することが問題となる.そこで今回はTickデータを使用する前に処理を施すことでノイズを除去しより正確な情報が得られるようにする.これにより真の情報を適用することでより最適なルールを決定できるようにする.

4 提案手法の概要

本研究では、リアルタイムで取得したTickデータから指標を算出し、より最適な売買ルールを自動的に選択するためにような手法を提案する.まず、最新のTickデータをMT5経由で取得し、それらに対してノイズ除去の処理をしたものをデータフレームに格納する.Tickデータを取得するタイミングは値動きがあったタイミングあり、取得したままの状態では時間感覚が一定ではないためインジケータの計算に使用することが難しい.そのため、一定時間ごとに得られたTickデータをリサンブルし、時間足のデータフレームとして保存し、インジケータの計算に利用する.時間足のデータが一定期間分貯まったら各インジケータで長期短期の両方でバックテストを行い複数の評価指標かにおける最終的な所持金を比較し一番利益が多い手法を短期長期の両方が取引を行うタイミングで実際に得られたルールに基づいて取引を行う.

別の例として、RSI(相対力指数)を用いた売買である.RSIとは、直近の一定期間において終値ベースで上昇変動と下以下落変動のどちらの勢いが強いのか計測しようとする指標である.RSIは50%を中心として0~100%の範囲で推移し、上昇局面に入ると数値が50%以上で推移し、下降局面に入ると数値が50%以下で推移する.通常、RSIが70~80%以上であれば相場は買われすぎで売りタイミング、逆にRSIが30~20%以下であれば相場は売られ過ぎで買いタイミングがあると判断される

どういう風にルールを決めているのかを詳しくかく。

5 数値実験並びに考察

6 おわりに

参考文献

[1] ” M2B(みつば) 学習支援システム ”, Learning Analytics Center,

Kyusyu Unibersity, Japan

[2] 温井慧、徐晴暉、安藤雅和 “ 強化学習を用いた金融市場取引
の取引ルール獲得に関する研究 (2020)

[3] 和泉潔 “ 人工市場による取引アルゴリズムの評価

[4] 尾畑伸明 “ ホワイトノイズ解析の新展開