Московской Биржи, Quandl, Finam.ru, Tushare и других источников. Применяются дневные и минутные значения, высокие, низкие, открытые и закрытые цены, объемы торгов и смещенные значения.

Также используются экономические индикаторы (цены на нефть, курс доллара, ВВП Китая), финансовые новости из LexisNexis, Reuters, Bloomberg, Kaggle, UCI и других источников, текстовые данные из социальных сетей (форумы, Twitter) и финансовые отчеты компаний. Анализируются данные по различным компаниям (Газпром, Apple, Сбербанк и др.), индексам (S&P 500, IHSG), а также отраслевые индексы.

Данные собираются через API (Pandas, Tushare, Worldtradingdata), веб-скраппинг и из аналитических отчетов. Временные периоды варьируются от 30 дней до нескольких лет (до 2017, 2019, 2023 гг.).