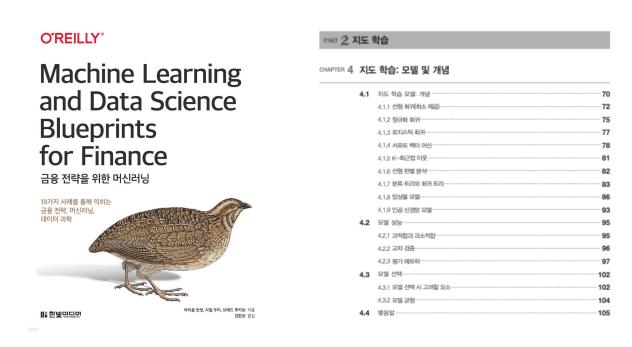
231030 금융AI 스터디

"금융 전략을 위한 머신러닝" 책 PART2의 Chapter 4 부분을 다루었습니다.



저희는 순서대로 책을 한번씩 읽어보며, 여러 가지 모델의 개념에 대해서 토의해보는 시간을 가졌습니다.

표 4-1 모델 선택

	선형 화귀	로지스틱 화귀	서포트 벡터 머신	결정 트리	경사 부스팅	랜덤 포레스트	인공 신경망	K- 최근접이웃	선형 판별 분석
단순성	~	*	~	~	×	×	×	~	~
훈련 시간	~	~	×	~	×	×	\times	~	~
비선형 처리	\times	×	~	~	~	~	~	~	~
과적합 안정성	×	\times	~	\times	×	~	\times	~	×
데이터셋 크기	×	\times	×	~	~	*	~	\times	✓
특성 수	×	\times	~	~	~	~	~	×	~
모델 해석	~	~	×	\times	~	~	×	~	~
특성 스케일링	×	×	~	~	×	×	×	×	×

표에서 보듯이, 상대적으로 단순한 모델은 선형 및 로지스틱 회귀 모델이며 양상불 및 인공 신 경망 모델로 갈수록 복잡해진다. 훈련 시간 측면에서는 선형 및 결정 트리 모델이 양상불 방법 및 인공 신경망 모델보다 더 빠르다.

선형 및 로지스틱 회귀 모델은 비선형적 관계를 처리할 수 없고, 서포트 벡터 머신은 비선형 커널을 이용해 독립 변수와 종속 변수 간의 비선형성을 처리할 수 있다.

231030 금융AI 스터디

추후 계획:

"금융 전략을 위한 머신러닝" 책은 스스로 공부하는 것으로 변경하였습니다.
⇒ "이론을 공부하기보다 실전에 부딪혀보자"라는 스터디원들의 의견을 모아, 다음 스터 디부터 금융 분야 쪽 캐글 지난 대회 코드를 분석해보기로 하였습니다.

대회 주제: 도쿄 시장 주식 거래 예측

https://www.kaggle.com/competitions/jpx-tokyo-stock-exchange-prediction

2023-10-31 스터디 인증



231030 금융AI 스터디 2