

Прогнозирование направления движения цены биржевых инструментов по новостному потоку.

*Ахияров В., Борисов А., Говоров И., Дробин М., Мухитдинова С.,
Родионов В.*

akhiarov.va@phystech.edu, borisov.as@phystech.edu, govorov.is@phystech.edu,
drobin.me@phystech.edu, muhitdinova.sm@phystech.edu, rodionov.vo@phystech.edu
МФТИ (ГУ)

Аннотация: В работе рассматривается задача классификации направления движения временных рядов. Классификация производится с помощью анализа признаков из отчётов 8-К, которые компании обязаны заполнять при значительных событиях, таких как банкротство, выбор совета директоров и пр. Рассматривается несколько моделей классификации. В одних используются только признаки из отчётов, 1-граммы которых встречаются более 10 раз. В других к предыдущему этапу применяется неотрицательная матричная факторизация (NMF). И в последней, ансамбле, объединяются предыдущие подходы путём голосования большинства. В качестве прикладной задачи рассматривается задача распознавания направления движения акций по новостям, выраженных отчётами 8-К. Модели классификации, исследованные в этой работе, сравниваются в точности и статистической значимости с простыми моделями, использующими только прогнозируемый показатель доход на акцию или использующую только финансовые показатели.

Ключевые слова: метрическая классификация, анализ текстов, классификация временных рядов, новостной поток