

- 第二组proposal

## 第二组proposal

---

石昕潼 阮珉源 陈奕玮

- 研究的问题：根据比特币的分钟级别K线，通过深度学习方法，实现量化交易预测。
- 有趣的原因：和本课程之前学习的内容有一定关联，更具有实战价值，可以探索的空间更大。
- 使用的数据：Binance交易所BTC-USDT-SWAP永续合约从2020年到2025年分钟级别K线的数据。
- 使用的方法：可能会尝试transformer、LSTM、GNN等较适合序列分析的模型。  
(可能可以参考一下论文：MASTER: Market-Guided Stock Transformer for Stock Price Forecasting)。
- 可能的尝试：尝试创新模型结构、对于数据增强的讨论、对于标签信息含量的选择、以及各种训练的trick
- 评估模型的结果：预测准确率、召回率、平均单笔收益、混淆矩阵等。
- 可能使用的技巧，结合金融的知识来评估，比如策略的夏普比率等