

# **Предсказание цен акций на 30 дней по топ компаниям MOEX**

# Команда



Ступников

Дмитрий



Садоян

Давид



Савин

Владислав



Клюшова

Ульяна

# Описание и цель проекта

Данные: 2 датасета с ценами 19 компаний и новостям с [finam.ru](https://finam.ru)  
за 5 лет

Бизнес-ценность: обоснованные инвестиционные решения,  
автоматическая агрегированная обработка новостей и цен вместе  
для управления портфелем

---

## Цель

Разработать эффективную модель для краткосрочного  
прогнозирования цен акций российского рынка (горизонт - 30  
дней), объединяющую ценовые данные и анализ новостного  
контекста



Если кто захочет заработать -  
принимает депозиты с комиссией  
5% от прибыли

писать @Dmitriy\_000

# Ключевая гипотеза

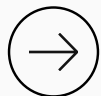
Синергия ценовых данных,  
технических индикаторов и  
опережающего сигнала новостей



Более точные и **надёжные**  
предсказания цен по сравнению с  
расчётом лишь из цен и  
индикаторов

# Данные

## Рыночные данные



Источник: [moex.com](https://moex.com)



Тикеры: 19 публичных компаний  
(верхушка моих рейтинга)



Признаки:

- `open, close, high, low` — цены открытия, закрытия, дневной максимум и минимум
- `volume` — объем торгов
- `date` — торговый день
- `ticker` — идентификатор компании

## Новостные данные



Источник: [finam.ru](https://finam.ru)

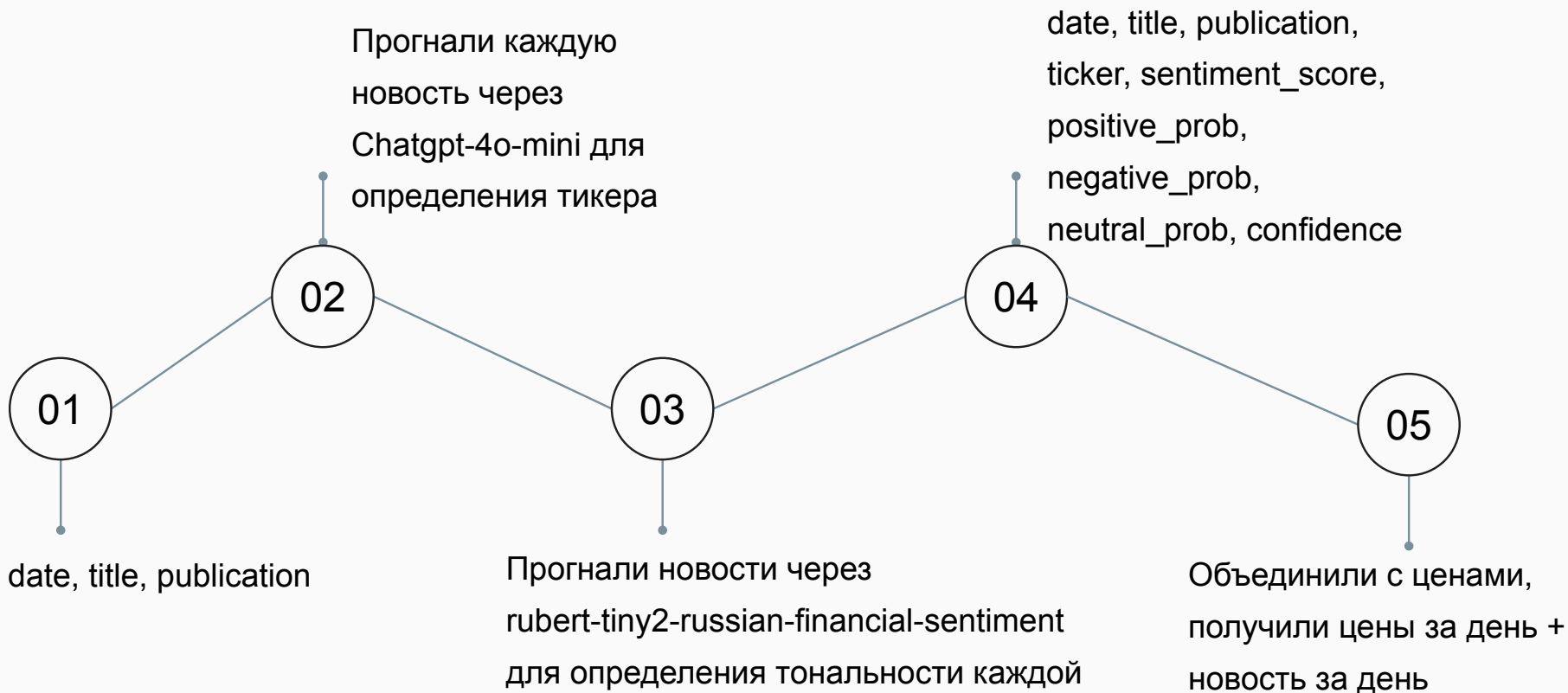


Признаки: `date, title, publication`

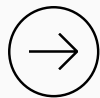


**Задача:** связать новости с конкретными компаниями и извлечь тональность

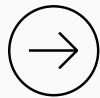
# Обработка новостей



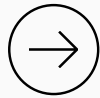
# Бейзлайн



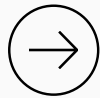
В качестве первой модели был выбран catboost



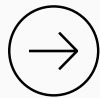
Результаты 1 дня: MAE = 0.017



Результаты 30 дня: MAE = 0.1574

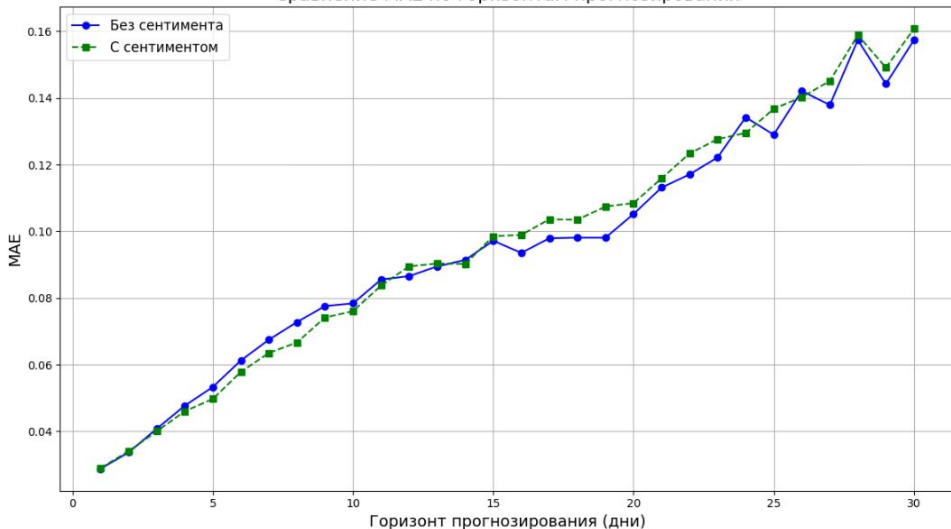


Пока прогноз на более долгий срок уж слишком плохой из-за сложных временных зависимостей



На бейзлайне гипотеза себя не оправдала: новости не особо влияют

Сравнение MAE по горизонтам прогнозирования



# Модели

- Catboost
- Random Forest
- Ridge

# Feature engineering



# Выводы и ограничения

## Основные выводы



Прокачиваем hard и soft skills  
Изучаем ML, аналитику, product management и готовимся к собесам



Получаем практические навыки в ML студии  
Защищаем проект перед бизнес-спонсором



Строим нетворк и развиваем насмотренность  
Разбираем кейсы и знакомимся с экспертами топовых компаний



### Цель

Оффер в топовую компанию во 2 семестре

<sup>1</sup> можно корректировать в зависимости от нагрузки на работе

## Ограничения текущего и что можно сделать еще



Три специализации на выбор

- Advanced ML
- Финансовая аналитика
- Product Management



Стартап студия

Попробуй запустить свой стартап  
и получить финансирование



### Цель

Грейдап в конце года