

Предсказание цен акций на 30 дней по топ компаниям МОЕХ

Команда



Ступников

Дмитрий



Садоян

Давид



Савин

Владислав



Ключова

Ульяна

Описание и цель проекта

Данные: 2 датасета с ценами 19 компаний и новостям с [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 -
принимаем 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



Тикеры: 19 публичных компаний
(верхушка тех рейтинга)



Признаки:

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

Новостные данные



Источник: finam.ru

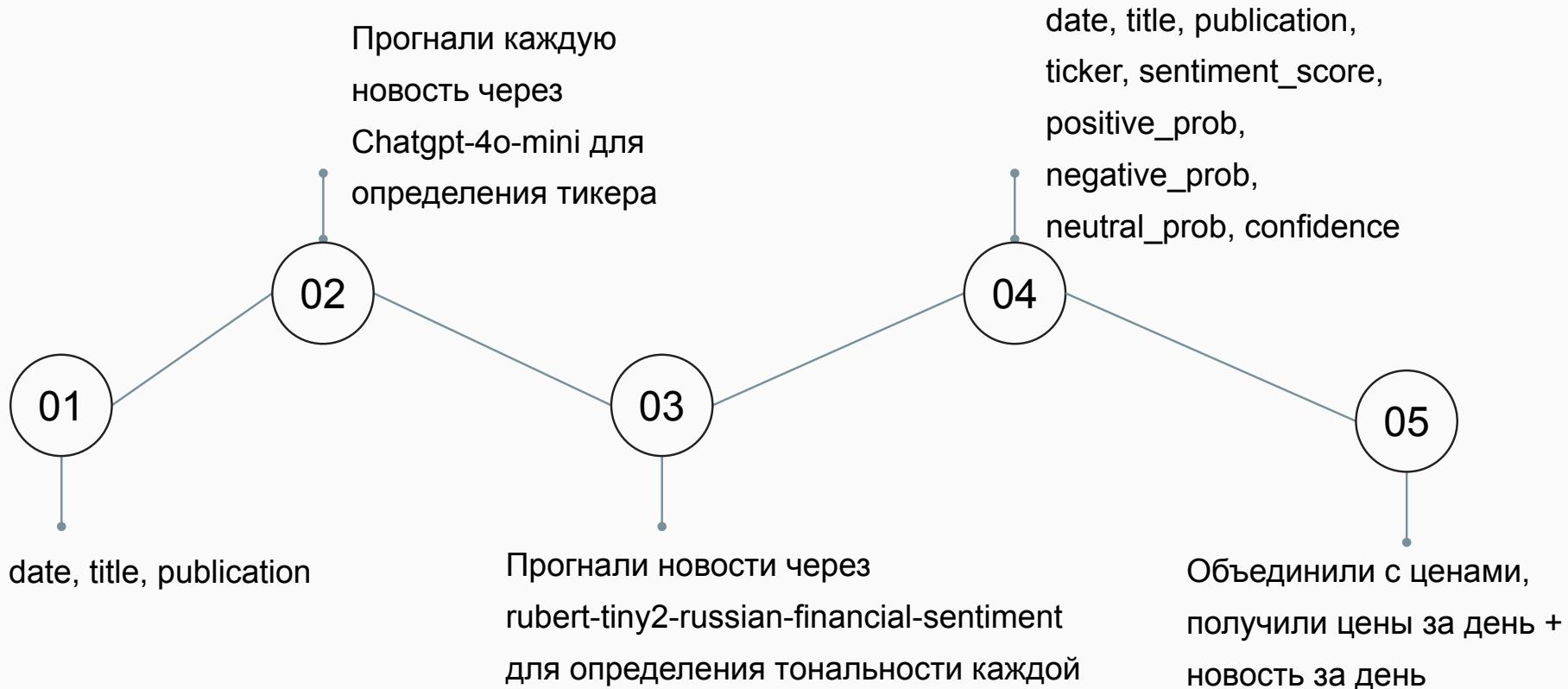


Признаки: `date, title, publication`



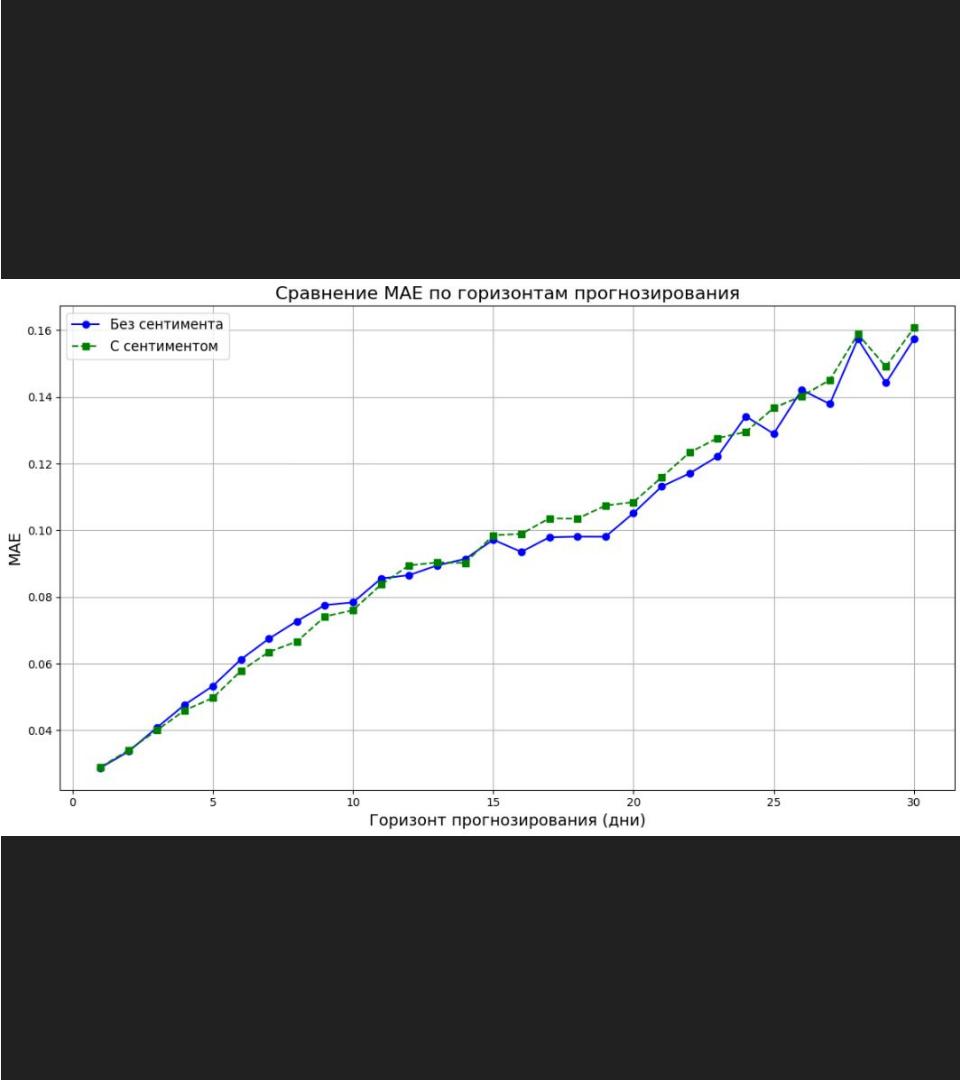
Задача: связать новости с конкретными компаниями и извлечь тональность

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



Модели

- Catboost
- Random Forest
- Ridge

Feature engineering

Выводы и ограничения

Основные выводы



Прокачиваем hard и soft skills



Получаем практические навыки в ML студии



Защищаем проект перед бизнес-спонсором



Цель

Оффер в топовую компанию во 2 семестре

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

¹ можно корректировать в зависимости от нагрузки на работе