|  |  |
| --- | --- |
| Gerb-BMSTU_01 | **Министерство науки и высшего образования Российской Федерации**  **Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение**  **высшего образования**  **«Московский государственный технический университет**  **имени Н.Э. Баумана**  **(национальный исследовательский университет)»**  **(МГТУ им. Н.Э. Баумана)** |

|  |  |
| --- | --- |
| ФАКУЛЬТЕТ | Робототехника и комплексная автоматизация (РК) |
| КАФЕДРА | Системы автоматизированного проектирования (РК6) |

**РАСЧЕТНО-ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА**

***К КУРСОВОМУ ПРОЕКТУ***

***НА ТЕМУ:***

***«Изучение сверточных нейронных сетей для задач анализа биржи и стратегии торговли брокера »***

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Студент РК6-76Б | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | **Онюшев А.А.** |
|  | (Подпись, дата) | И.О. Фамилия |
| Руководитель курсового проекта | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | **Витюков Ф.А.** |
|  | (Подпись, дата) | И.О. Фамилия |

*2023 г.*

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение**

**высшего образования**

**«Московский государственный технический университет имени Н.Э. Баумана**

**(национальный исследовательский университет)»**

**(МГТУ им. Н.Э. Баумана)**

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой РК6

А.П. Карпенко

«\_\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 20 \_\_\_\_ г.

**ЗАДАНИЕ**

**на выполнение курсового проекта**

по дисциплине \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_Модели и методы анализа проектных решений\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Студент группы \_\_\_\_РК6-76Б\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_Онюшев Артем Андреевич\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

(Фамилия, имя, отчество)

Тема курсового проекта: Изучение сверточных нейронных сетей для задач анализа биржи и стратегии торговли брокера\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Направленность КП (учебный, исследовательский, практический, производственный, др.) учебный\_\_\_

Источник тематики (кафедра, предприятие, НИР) \_\_кафедра\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

График выполнения проекта: 25% к 5 нед., 50% к 11 нед., 75% к 14 нед., 100% к 16 нед.

***Задание.*** Разработать архитектуру нейронной сети на основе сверток. Разработать кастомный датасет для загрузки необходимых данных в НС. Подобрать необходимые настройки и параметризации для НС. Обучить НС и провести исследование её пригодности для анализа биржи и стратегии торговли брокера\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

***Оформление курсового проекта:***

Расчетно-пояснительная записка на 32 листах формата А4.

Перечень графического (иллюстративного) материала (чертежи, плакаты, слайды и т.п.):

3 графических листа\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Дата выдачи задания «8» октября 2023 г.

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Руководитель курсовой работы** | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | **Витюков Ф.А.** |
|  | (Подпись, дата) | И.О. Фамилия |
| **Студент** | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | **Онюшев А.А.** |
|  | (Подпись, дата) | И.О. Фамилия |

Примечание: Задание оформляется в двух экземплярах: один выдается студенту, второй хранится на кафедре.

АННОТАЦИЯ

В данной работе рассмотрено, что такое сверточная нейронная сеть и чем она отличается от простого линейного перцептрона, описана работа по настройке и подбору нужных нам функций-оптимизации, функций-потерь и функций активации, а также размера и количества нейронных слоев и сверточных слоев. Также в данной работе будут проведены тесты с разными настройками и проанализированы результаты, полученные на выходе.

В расчётно-пояснительной записке 32 страницы, 21 рисунок, 3 графических листа.

СОДЕРЖАНИЕ

[АННОТАЦИЯ 3](#_Toc159115858)

[ОСНОВНЫЕ ПОНЯТИЯ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ 5](#_Toc159115859)

[ВВЕДЕНИЕ 6](#_Toc159115860)

[1. Устройство CNN 7](#_Toc159115861)

[2. Изображение «в глазах» компьютера 9](#_Toc159115862)

[3. Свертка 11](#_Toc159115863)

[4. Слой подвыборки (пулинга) 13](#_Toc159115864)

[5. Собственная CNN 14](#_Toc159115865)

[ЗАКЛЮЧЕНИЕ 17](#_Toc159115866)

[СПИСОК ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ИСТОЧНИКОВ 18](#_Toc159115867)

ОСНОВНЫЕ ПОНЯТИЯ И ОПРЕДЕЛЕНИЯ

**НС** – Нейронная сеть

**CNN** – Сверточная НС

**Функция-потерь** – Функция показывающая расстояние от предугаданного НС ответа до истинного ответа

**Функция-активации** – Функция отвечающая за изменение весов синапсисов

**Тикер** – Краткое название в биржевой информации котируемых инструментов (акций, облигаций, индексов)

**EMA** – (Exponential Moving Average) Экспоненциальная скользящая средняя. Один из показателей, помогающих при техническом анализе.

**Stop-Loss** – Биржевая заявка трейдера, в которой условием исполнения указано достижение цены, которая хуже, чем текущая рыночная.

**Take-Profit** – Биржевая заявка трейдера, которая выставляется заранее, чтобы в случае роста рынка зафиксировать прибыль по бумаге

ВВЕДЕНИЕ

В настоящее время область сверточных нейронных сетей (CNN) активно исследуется и применяется в различных областях, включая финансовый рынок и биржевую торговлю. CNN позволяют анализировать и обрабатывать большие объемы данных, что идеально подходит для работы с финансовой информацией, которая обычно является многомерной и динамичной.

Использование CNN для анализа биржи и стратегий торговли брокера может быть эффективным способом прогнозирования рыночных движений и принятия обоснованных решений о покупке или продаже активов. Эти модели имеют преимущество в распознавании сложных закономерностей и паттернов на графиках цен, что может помочь в принятии более точных и выгодных решений.

Данное исследование будет сосредоточено на разработке и оптимизации сверточных нейронных сетей для анализа данных биржи и выработки стратегий торговли для брокеров. В этом исследовании рассмотрены различные подходы к построению моделей CNN, включая архитектуру сети, выбор оптимальных гиперпараметров и оптимизацию процесса обучения. Также будет проведен анализ полученных НС результатов для разных настроек.

Целью данного исследования является анализ пригодности CNN для выведения таких сложных закономерностей, как стоимости тикеров.

1. Устройство CNN

Сверточная нейронная сеть (ConvNet/CNN) — это специальная архитектура искусственных нейронных сетей, которая может принимать входное изображение, присваивать важность (изучаемые веса и смещения) аспектам или объектам изображении и отличать одно от другого. При этом изображения в сравнении с другими архитектурами НС требуют гораздо меньше предварительной обработки. В примитивных методах фильтры разрабатываются вручную, но достаточно обученные сети CNN учатся применять эти фильтры/характеристики самостоятельно.

Архитектура CNN аналогична структуре связей нейронов в мозгу человека, учёные черпали вдохновение в организации зрительной коры головного мозга. Отдельные нейроны реагируют на стимулы только в некоторой области поля зрения, также известного как перцептивное поле. Множество перцептивных полей перекрывается, полностью покрывая поле зрения CNN.

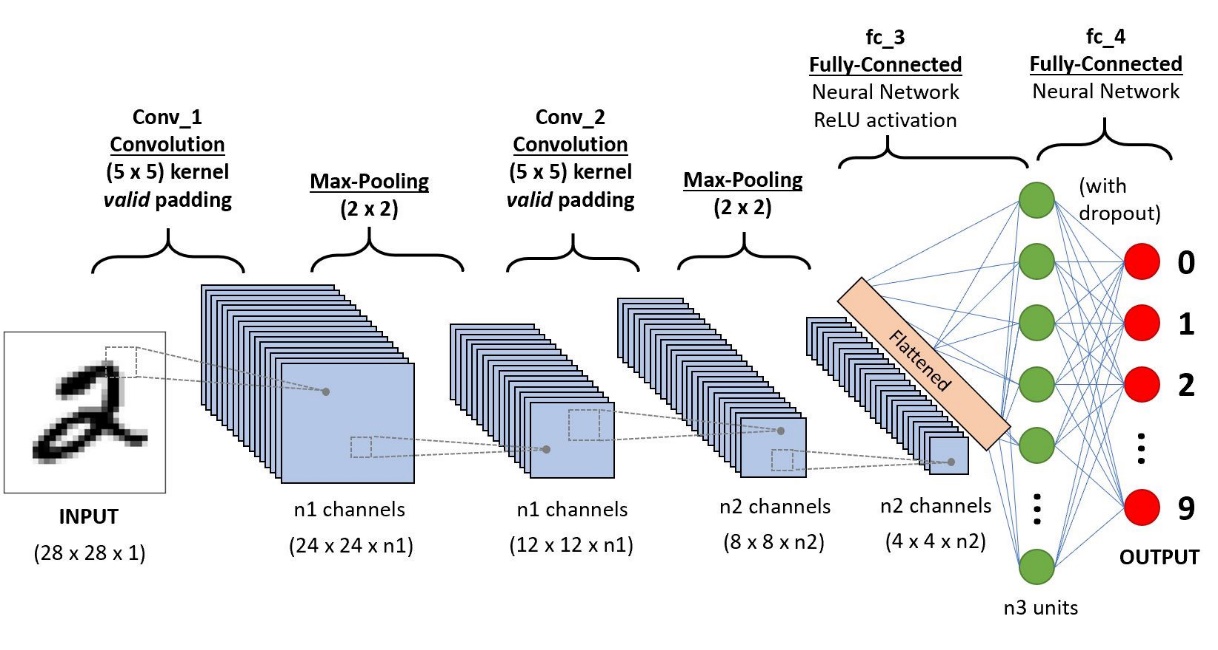


Рис. 1 Архитектура сверточной нейронной сети

Главной особенностью свёрточных сетей является то, что они обычно работают именно с изображениями, а потому можно выделить особенности, свойственные именно им. Многослойные персептроны работают с векторами, а потому для них нет никакой разницы, находятся ли какие-то точки рядом или на противоположных концах, так как все точки равнозначны и считаются совершенно одинаковым образом. Изображения же обладают локальной связностью. Например, если речь идёт об изображениях человеческих лиц, то вполне логично ожидать, что точки основных частей лица будут рядом, а не разрозненно располагаться на изображении. Поэтому требовалось найти более эффективные алгоритмы для работы с изображениями и ими оказались свёрточные сети.

1. Изображение «в глазах» компьютера

Изучая CNN невольно появляется вопрос «Что такое свертка?». Перед тем, как ответить на него, нужно разобраться, как компьютер «видит» какое-то изображение.



Рис. 2 Как компьютер видит изображение

Изображения в компьютере представляются в виде пикселей, а каждый пиксель – это значения интенсивности соответствующих цветовых каналов. При этом интенсивность каждого из каналов описывается целым числом от 0 до 255. Чаще всего используются цветные изображения, которые состоят из RGB пикселей – пикселей, содержащих яркости по трём каналам: красному, зелёному и синему. Различные комбинации этих цветов позволяют создать любой из цветов всего спектра. Чтобы хранить информацию о всех пикселях удобнее всего использовать тензор ‒ 3D массив чисел, или, проще говоря, массив матриц чисел.



Рис. 3 Преобразование из изображения в тензор



Рис 4. Изображение цифры и его представление в компьютере.

1. Свертка

Слой свёртки, как можно догадаться по названию типа нейронной сети, является самым главным слоем сети. Его основное назначение – выделить признаки на входном изображении и сформировать карту признаков. Карта признаков – это всего лишь очередной тензор (массив матриц), в котором каждая матрица отвечает за какой-нибудь выделенный признак.

Для того, чтобы слой мог выделять признаки, в нём имеются так называемые фильтры (или ядра). Фильтр – квадратная матрица небольшого размера (обычно 3х3 или 5х5), заполненная определенным образом. Чем больше будет таких фильтров – тем больше признаков удастся выделить и тем больше будет глубина каналов у выходного тензора слоя

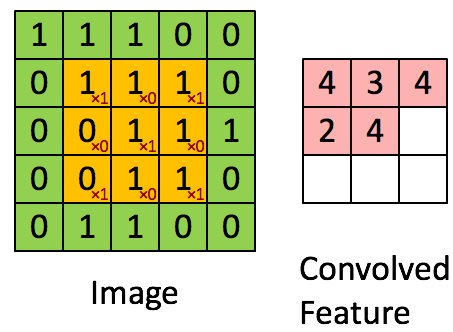


Рис. 5 Свертка изображения 5х5х1 с фильтром 3х3х1 для получения признака 3х3х1

Данный фильтр поочередно накладывается на изображение начиная с левого верхнего угла и пока не дойдет до правого нижнего угла. На каждом шаге числа в матрице фильтра перемножаются с соответствующими числами на изображении, полученные результаты складываются и записываются в матрицу признака. Лучше понять это можно, посмотрев на рисунок 5. На нем желтым цветом изображен фильтр размером 3х3х1, а красные цифры в правом углу –числа матрицы фильтра. Зеленым цветом изображена матрица изображения 3х3х1, а красным полученный признак. Таким образом на 5-ом шаге итерации мы получим:

Полученные в итоге матрицы признаков могут иметь такой же размер, что и исходное изображение, либо размер меньше (как в нашем случае). Это зависит от заданных размера шага и начального заполнения. В [этом](https://github.com/vdumoulin/conv_arithmetic) репозитории можно найти множество разных GIF- файлов, которые помогут лучше понять, как заполнение и длина шага работают.

1. Слой подвыборки (пулинга)

Так как сверточные НС используют так же и простую сеть прямого распространения, нам необходимо уменьшить кол-во выходных параметров из слоя свертки и при этом не потерять важную информацию. Для этого используют слои подвыборки.

Данный слой позволяет уменьшить пространство признаков, сохраняя наиболее важную информацию. Существует несколько разных версий слоя пулинга, среди которых максимальный пулинг, средний пулинг и пулинг суммы. Наиболее часто используется именно слой макспулинга.

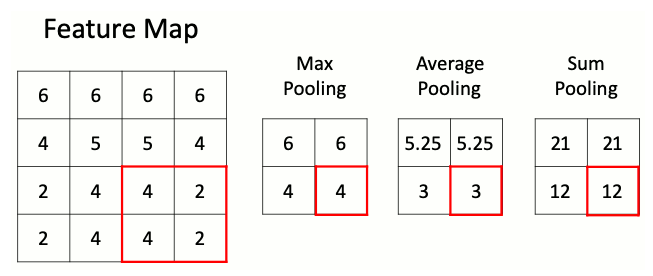


Рис. 6 Преобразования слоя подвыборки

Действия этого слоя идентичны действиям слоя свертки, только используются другие операции (для макспулинга – берется максимальное число, для среднего пулинга – берется среднее арифметическое от чисел).

1. Собственная CNN

Изучив, как устроена сверточная нейронная сеть, можно приступать к написанию собственной.

1. Работа с yahoo finance

Изучив, как устроена сверточная нейронная сеть, можно приступать к написанию собственной.

Для получения необходимой информации о дневных свечах тикера, необходимо обратится к API yahoo finance, но так как они прекратили его поддержку в 2016 году, воспользуемся модулем yfinance.

Чтобы выбрать конкретный тикер, создадим переменную ticker (смотреть листинг 2). Чтобы выбрать количество дней информацию по которым мы хотим получить, создадим переменную days (смотреть листинг 2). Чтобы выбрать количество дней для ЕМА введем переменную EMA\_N (смотреть листинг 2).

Функция fin.download() (смотреть листинг 2) загрузить всю необходимую нам информацию о свечах, а код указанный в листинг 3 создаст столбец с информацией о EMA.

Итоговая таблица будет иметь вид, указанный на рисунке 3.

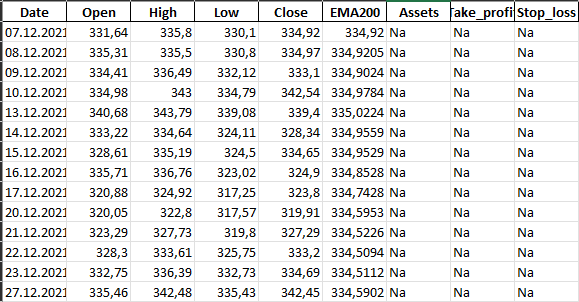


Рисунок 3. Итоговый вид таблицы датасета

1. Проведение анализов

Изучив, как устроена сверточная нейронная сеть, можно приступать к написанию собственной.

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

В ходе выполнения эксплуатационной практики прошло ознакомление с написанием искусственного интеллекта на основе НС. Изучены возможности модуля PyTorch языка программирования Python. Разобраны главные математические и биологические основы НС.

Создан линейный перцептрон с возможностью обучения на различных датасетах. Изучены различия в поведении разных функций-оптимизаторов и функций-потерь. Изучены перемены, которые появляются при изменение параметров нейронной сети. Разобрана теоретическая составляющая для сверточных нейронных сетей.

При обучении НС на датасете, составленном по показателям дневных свечей на бирже, можно понять, что линейный персептрон плохо находит закономерность. Нужен либо датасет большего размера, либо другая структура и архитектура НС, но для данной архитектуры подобранные параметры являются оптимальными.

СПИСОК ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ИСТОЧНИКОВ

1. «Сверточная нейронная сеть с нуля» [Электронный ресурс] ‒ URL: <https://programforyou.ru/poleznoe/convolutional-network-from-scratch-part-zero-introduction> (дата обращения: 20.10.2023 - 24.10.2023);
2. Блог о сверточной нейронной сети [Электронный ресурс] ‒ URL: <https://habr.com/ru/companies/skillfactory/articles/565232/> (дата обращения: 20.10.2023);
3. PyTorch Tutorials [Электронный ресурс] – URL: <https://pytorch.org/tutorials/> (дата обращения: 20.10.2023 - 30.10.2023);
4. PyTorch Documentation [Электронный ресурс] – URL: [https://pytorch.org/docs/stable/index.html](https://pytorch.org/docs/stable/index.html%20) (дата обращения: 20.10.2023 - 30.10.2023);
5. Сайт с датасетами [Электронный ресурс] – URL: <https://www.kaggle.com/datasets/d4rklucif3r/cat-and-dogs?select=dataset> (дата обращения: 21.10.2023).

Приложение