

BẢN NHẬN XÉT KHÓA LUẬN TỐT NGHIỆP

(HƯỚNG NGHIÊN CỨU)

Tên đề tài : Nghiên cứu cải tiến dự đoán giá chứng khoán dựa vào độ tương đồng trên chuỗi thời gian

Sinh viên thực hiện : 1712834 – Trần Minh Trí

1712852 – Nguyễn Nhật Trường

Giảng viên hướng dẫn: ThS. Trần Văn Quý

1. Chủ đề và ý tưởng nghiên cứu:

Mục tiêu nghiên cứu của khóa luận này là cải tiến, khắc phục các hạn chế của nghiên cứu Lior Sidi trên ý tưởng dự đoán giá chứng khoán dựa vào độ tương đồng trên chuỗi thời gian, mong muốn đem tới kết quả cải tiến tốt hơn.

2. Phương pháp nghiên cứu:

Khóa luận sử dụng hai tập dữ liệu, một tập dữ liệu S&P 500, dữ liệu theo khung thời gian ngày trong 5 năm được lấy từ nguồn cơ sở sẵn có để có thể so sánh với kết quả cải tiến của khóa luận này. Nguồn dữ liệu còn lại lấy từ S&P 500 theo khung thời gian theo giờ lấy từ Yahoo Finance API. Tập dữ liệu này dùng để chứng minh phương pháp áp dụng tương đồng đã qua cải tiến của nhóm có thể áp dụng với các tập dữ liệu có khung thời gian khác nhau.

3. Đóng góp Khoa học và thực tiễn:

Nhóm sinh viên đã cải tiến, tinh chỉnh hợp lý việc áp dụng dữ liệu từ nhiều loại cổ phiếu liên quan trong huấn luyện để dự đoán giá/ xu hướng của một loại cổ phiếu và dùng kết quả này để thực nghiệm trên tập dữ liệu khác với khung thời gian khác để thử nghiệm tính khách quan của phương pháp này. Từ kết quả nghiên cứu này, mở ra một cách tiếp cận hiệu quả trong việc dùng máy học để dự đoán giá/ xu hướng chứng khoán.

4. Quá trình thực hiện:

Nhóm sinh viên đã rất nghiêm túc trong quá trình nghiên cứu và hoàn thành khóa luận. Tuy hạn chế về tài nguyên để thực hiện chạy thí nghiệm, nhưng nhóm đã cố gắng chạy thí nghiệm liên tục

trong nhiều tháng trời để tìm ra kết quả tốt nhất. Ngoài ra nhóm sinh viên rất chủ động trong việc tìm hiểu và giải quyết những vấn đề khó khăn trong quá trình thực hiện khóa luận.

5. Báo cáo viết:

Báo cáo viết đầy đủ, súc tích, hàm lượng về kiến thức trong lĩnh vực chứng khoán cũng như nghiên cứu thử nghiệm mang lại những giá trị rất ý nghĩa, chi tiết, rõ ràng thể hiện nhóm sinh viên đã bỏ ra rất nhiều công sức để tìm hiểu tường tận vấn đề.

6. Trình bày trước hội đồng:

Nhóm sinh viên đã trình bày và trả lời rất tốt các câu hỏi của hội đồng.

7. Công bố khoa học/ ứng dụng thực tế:

Chưa công bố.

Đánh giá xếp loại: Xuất Sắc

TP.HCM, ngày 05 tháng 07 năm 2021

Giảng viên hướng dẫn

(Ký và ghi rõ họ tên)



Trần Văn Quý