

Plan 3-4 weeks

На данном моменте у нас есть подготовленные данные для применения алгоритмов машинного обучения. Нам необходимо построить:

1. Модель, которая позволяла оценить будущую доходность по каждому инструменту. При этом эти данные должны быть сравнимые между инструментами.
2. Структуру оценки перформанса модели.

После того, как мы оценим будущую доходность необходимо отранжировать их внутри каждого дня для того, чтобы отобрать топ N лучших. N - параметр. Его также оптимизировать в рамках перформанса портфеля.

Далее надо построить вектор весов на каждый день. Веса определяются на ваше усмотрение (можно это делать взвешенным по капитализации, моменту и тд)

Следующим этапом необходимо построить перформанс модели. Перформанс должен показывать:

- Показатель Шарпа (безрисковую ставку можно принять 0%)
- Показатель Сортино
- Годовую доходность
- Максимальную просадку
- Среднегодовой оборот

В подсчете перформанса должна учитываться комиссия за ежедневный ребаланс портфеля в размере 0.0025%.

Заключительным этапом необходимо сделать оптимизацию перформанса модели по параметрам. Параметры включают в себя размер N, вид взвешивания портфеля, параметры модели машинного обучения.