

[Day 02] 2020-01-07

다양한 모형 고려

RNN, GRU, LSTM, ARIMA 등의 대표적인 시퀀스 모델뿐만 아니라, CNN, DNN, Machine Learning 기법들.....

Model Stacking

PROPHET은 GPU 사용이 가능..? / ARIMA 모형의 통계적, 수학적 이해

Validation Set 추가

Train : Valid : Test = 8 : 1 : 1

추가로 제공된 데이터의 활용방안

각 종목별 거래구분, 시장종류 등에 대한 설명이 담겨있음. 전체 종목을 아우를 수 있는 모형의 구축이 필요함.

$$y = ax + b$$

현재 모델 상황

<SK 하이닉스>

- 80000원대 주식 가격 형성
- Model 1 : 2370.326409204249 / LSTM / shift 12 / 1층 / Close만 사용 / 1일 뒤 예측
- Model 2 : 1107.1313420829965 / LSTM / shift 12 / 1층 / OHLC 사용 / 1일 뒤 예측
- Model 3 : 1866.234512342344 / LSTM / shift 12 / 3층 / LSTM, DENSE 10 / OHLC 사용 / 5일 뒤 예측
- Model 4 : 2179.641231646546 / LSTM / shift 12 / 3층 / LSTM, DENSE 100 / OHLC 사용 / 5일 뒤 예측
- Model 5 : 진행중 / LSTM / shift 12 / 3층 / LSTM, DENSE 12 / OHLC 사용 / 5일 뒤 예측