

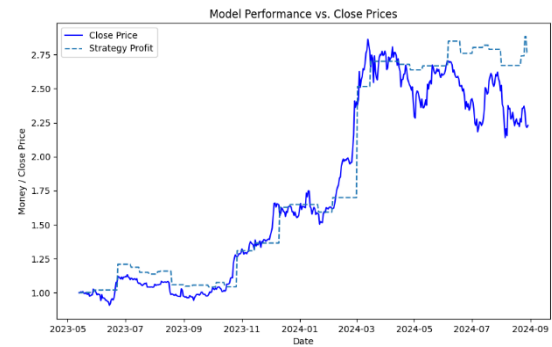
CNN의 결과는 다음과 같다.

Profit percentage: 0.4410609937991178

Cumulative return: 1.7645204272391952

Volatility: 0.6336325690163079

Sharpe ratio: 2.7847691446456904



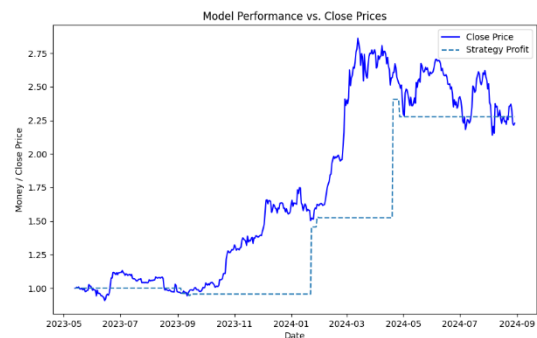
ViT의 결과는 다음과 같다.

Profit percentage: 0.3191951065855668

Cumulative return: 1.277008127154983

Volatility: 0.7826266807729421

Sharpe ratio: 1.6316951089551115



Sharpe ratio와 Profit percentage 모두 CNN을 이용한 방법이 더 높은 것을 알 수 있다. 이는 CNN 방식이 리스크 대비 더 높은 수익률을 낼 수 있으며, 단순 수익률 측면에서도 더 높다는 점을 의미한다. Volatility를 비교하면 ViT가 더 높음을 알 수 있는데, 이는 ViT를 이용한 방식이 리스크가 더 크다는 점을 의미한다.

즉, 대체로 학습한 두 모델을 비교하면 CNN이 리스크는 적고, 수익률도 전반적으로 더 뛰어남을 시사한다.

더 좋은 성능을 내기 위해서는 첫 번째로 두 모델 모두 추가적인 데이터를 학습에 이용하는것이 방법이 될 수 있다. 또한, 하이퍼파라미터를 더 좋은 방법을 통해 개선하면 모델이 더 좋은 성능을 낼 수 있다.

또한, 두 모델을 함께 사용하는 앙상블을 이용하면 어느 개별 모델 하나의 성능향상은 아니더라도 투자 수익률 측면에서 더 좋은 목표를 달성할 수 있을것으로 예상된다.