報告日期 : 6 / 8 大概

Data 範圍

訓練Data : 2015/08/08 - 2019/3/21 (大約2000eposide)

測試Data : 2019/7/1 - current

Data 內容

Bitcoin Ethereum MXR

環境

Observation space: [資產, 當前價值\*3, 擁有數量\*3, 各種指數\*12 ]---19 dim

Action space: [-1~1]\*3 最大交易量為1單位 per step ---3 dim

Reward: 資產(after action) - 資產(before action)

State update: 資產需考慮交易過程fee cost

當前價值為close price

資料處理

Dataframe : Date, tic, open, close, high, low, volume

Stockstat: 處理產生 cci, rsi, macd, adx

資料來源: <https://coinmarketcap.com/zh-tw/historical/>

Paper

概述 : <https://blog.csdn.net/weixin_26704853/article/details/108515764>

Github : <https://github.com/AI4Finance-LLC/Deep-Reinforcement-Learning-for-Automated-Stock-Trading-Ensemble-Strategy-ICAIF-2020>

演算法

A2C, DDPG, PPO