

現在、こちらのフォーラムを参考にしてモデルを作成しています。

[Signals: Plugging in the data from Quandl](#)[

Signals

](/c/signals/10)

Quandl example model: [example_model_quandl.py](#) Google Colab notebook: [Signals_Quandl_EOD_baseline.ipynb](#) Quandl is a financial, economic, alternative data marketplace which provides premium and free data. One such data source is [End of Day US Stock Prices by QuoteMedia](#) (premium, so need to set API_KEY in example_model_quandl.py).

Updated daily, this data feed offers end of day prices, dividends, adjustments and splits for US publicly traded stocks with history to 1996. Prices are provided bot...

R256 ではsklearn のGradientBoostingRegressorを用いてモデルを作成しました。以下がそのパフォーマンスです。

[

スクリーンショット 2021-03-26 0.06.37

1818×1166 179 KB

](https://forum.numer.ai/uploads/default/original/1X/5de517770aaa0eb6888dbe512d804007d225a9d8.jpeg)

データのノイズが多いからか、n_estimators が大きすぎるとテストデータでのパフォーマンスが悪いのが印象的でした。Tournamentでも使える知見が得られそうです。

tree の数が少ない場合にもパフォーマンスが良いとされるrotation forest がうまくワークするかも？

[Packt Hub – 28 Oct 15](#)

[Rotation Forest - A Classifier Ensemble Based on Feature Extraction | Packt Hub](#)

In this article by Gopi Subramanian author of the book Python Data Science Cookbook you will learn bagging methods based on decision tree-based

Est. reading time: 16 minutes

オルタナティブデータなどを用いることができれば面白そうですが、どうやって銘柄分集められるのかわからないでいます。