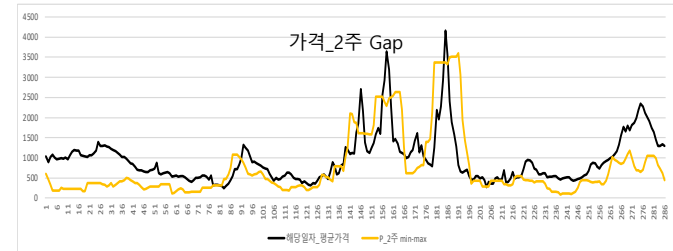
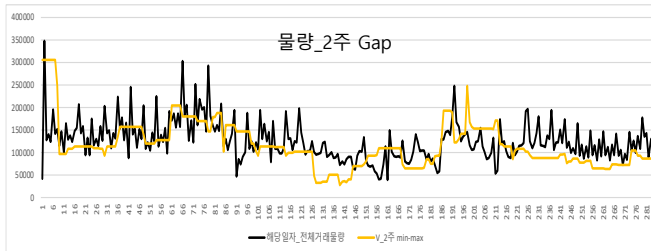


3-1 IV. Data 전처리

▶ Data 전처리 ① 파생변수 – 2. min-max Gap

- min-max gap : 시계열 상의 최대값과 최소값의 차이, 가격 추세와 변동성을 측정
- 2주 간격이 가격 추세를 가장 근접하게 설명



▶ Data 전처리 ① 파생변수 - 3. ROC(Rate of Change)

- $ROC = (\text{current value} - \text{previous value}) / \text{previous value}$
- ROC : 기준 날짜와 과거날짜와의 가격 변동률을 측정하여 일자 별 변동성 측정

