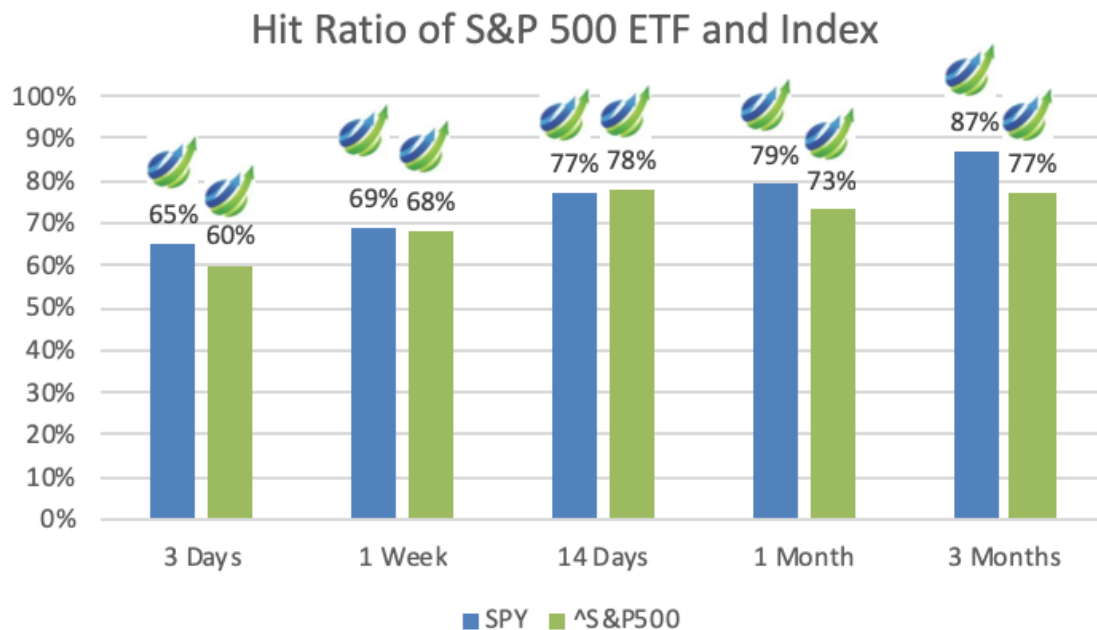


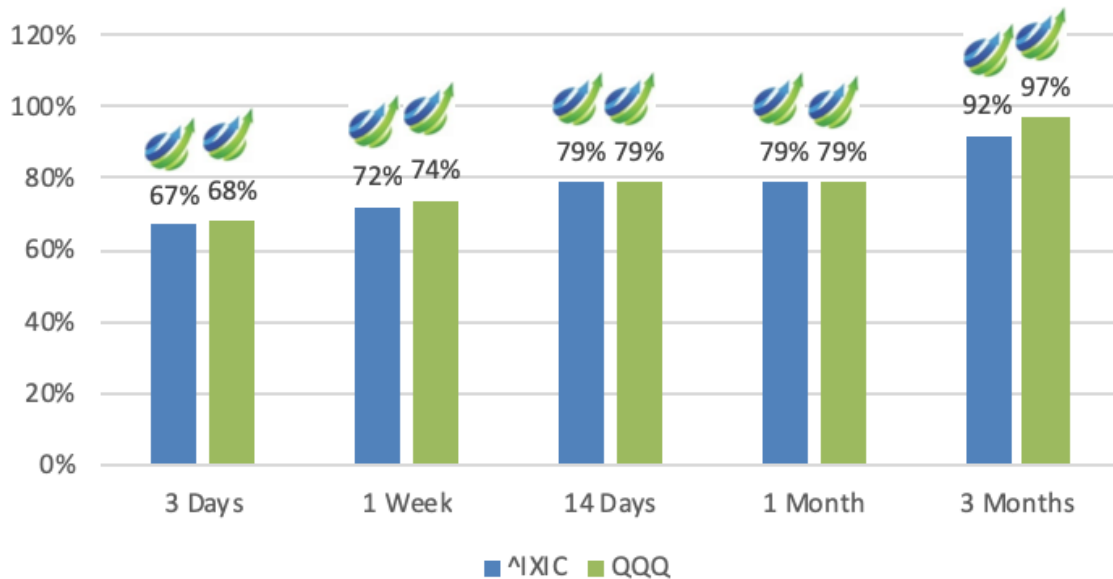
株式市場の予測：I Know First の S&P 500 & Nasdaq の評価レポート-最大 97%の精度
2019年8月15日

株式市場予測エグゼクティブサマリー

この予測評価レポートでは、S&P 500 および Nasdaq インデックス用の I Know First AI アルゴリズムによって生成された株式市場予測のパフォーマンスを検証します。これは、3日から3か月の範囲であり、顧客に毎日配信されました。当社の分析は、2019年1月1日から2019年8月1日までの期間を対象としています。以下では、株式市場予測のヒット率を確認するための重要なポイントを示します。



Hit Ratio of NASDAQ Index and ETF

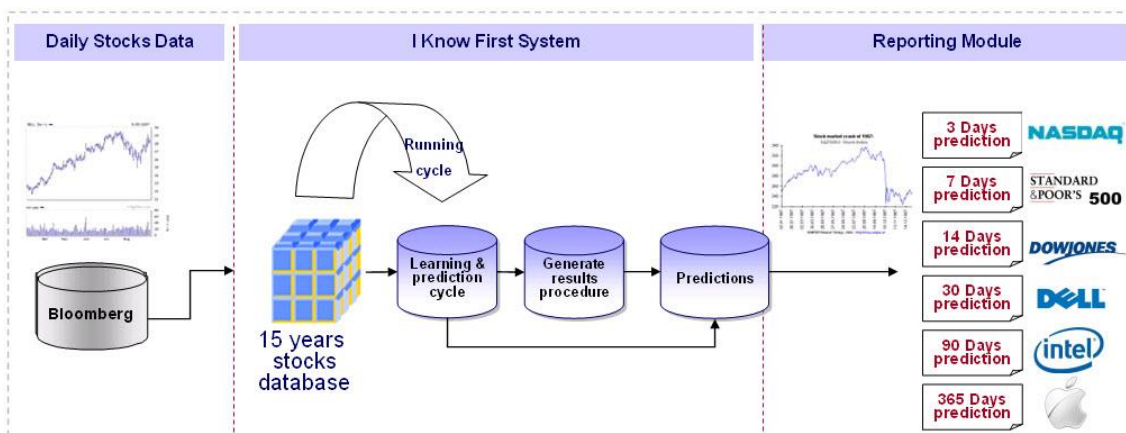


株式市場予測のハイライト：

- Nasdaq トラッキング ETF (QQQ) 予測の 3 か月間のヒット率が 97%であるため、クライアントは大幅に少ないリスクでお金を投資できます。
- ETF (SPY) 予測に続く S&P 500 の 3 か月の期間のヒット率 87%は、アルゴリズムの Nasdaq 予測の完璧な精度の成功にほぼ一致します。
- 過去半年間の世界経済の非常に不安定な時期にもかかわらず、常に 60%を超える正確な予測

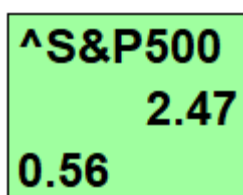
上記の結果は、S&P 500 および Nasdaq の動きを説明するために特定の期間にわたって実施された評価の結果として得られたものであることに注意してください。次のレポートでは、方法論の詳細な説明と、評価中に取得したパフォーマンスメトリックの詳細な分析を提供します。このレポートは、Nasdaq および S&P 500 インデックスの予測を成功させる能力を示す新しい I Know First 評価シリーズです。

I Know First アルゴリズムについて



I Know First 自己学習アルゴリズムは、株式、債券、通貨、商品、金利などの資本市場の株式市場予測を分析、モデル化し、提供します。このアルゴリズムは、人工知能 (AI) と機械学習 (ML) に基づいており、人工ニューラルネットワークと遺伝的アルゴリズムの要素が組み込まれています。

システムは、予測されたトレンドを、正または負の数値として出力します。また、予測されたトレンドと波がどのように重なるかを予測する波形チャートも出力します。その結果、トレーダーは、取引する方向、いつ取引を開始するか、いつ取引を終了するかを決定できます。このモデルは 100% 経験的であり、事実データのみに基づいているため、人間の仮定に伴うバイアスや感情を回避できます。First のモデルは、数学的なフレームワークを構築し、システムへの入力と出力の初期セットを提供する際にヒューマンファクターのみを必要とします。このアルゴリズムは、シグナルと予測可能性インジケータを備えた予測を生成します。信号は、ボックスの中央にある数字です。予測可能性は、ボックスの下部にある数字です。上部で、特定の資産が識別されます。この形式は、すべての予測にわたって一貫しています。



予報の表示例

このアルゴリズムは、インデックスに 2 つの独立したインジケータ (シグナルと予測可能性) を提供します。

信号は、インデックスの動きの予測される強度と方向です。これは、 $-\text{inf}$ から $+\text{inf}$ で測定されます。

予測可能性は、信号に対する信頼性を示します。予測可能性は、過去のアルゴリズムのパフォーマンスと実際の市場の動きに関連するピアソン相関係数であり、 -1 から 1 で測定され

ます。ヒートマップの詳細な説明は[こちら](#)で確認できます。

ヒット率の計算

ヒット率は、アルゴリズムの予測の精度を識別するのに役立ちます。

アルゴリズムを使用して、S&P 500 および Nasdaq インデックスの動きの方向を予測します。その後、予測を、同じ期間内での S&P 500 および Nasdaq ベンチマークの実際の動きと比較します。

ヒット率は、次のように計算されます。

$$\text{Hit Ratio Percentage (\%)} = \left(\frac{\text{Correctly Predicted Movement of the S\&P500 Index}}{\text{Total Number of Times S\&P500 is Predicted}} \right) * 100$$

S&P 500 インデックスと SPY ETF

インデックスファンドを経済全体のベンチマークと考えると、多くの専門家が S&P 500 のチェックに引き寄せられる傾向があります。インデックスが本質的に行うことは、時価総額の順で 500 社の上場企業を選択し、追跡対象企業の四半期リストを作成することです。これらの株式がどのように上昇または下落するかを先取的に示すことは、投資家にとって強力で収益性の高いツールになる可能性があることは明らかです。

同時に、SPY は最もよく認識されている最も古い ETF であり、通常、最大の AUM と最大の取引量のランキングでトップです。このファンドは、米国で大人気のインデックスである S&P 500 を追跡します。S&P のインデックス委員会が、米国の大型株スペースを表す 500 銘柄を選択していることを知っている人はほとんどいません。それでも、インデックスは米国の大型株スペースへの顕著なエクスポージャーを提供します。SPY はユニット投資信託であり、古い完全に実行可能な構造です。ディストリビューション間でポートフォリオの配当を再投資することはできません。結果として生じるキャッシュドラッグは、アップマーケットでのパフォーマンスをわずかに低下させ、ダウントレンドを助けます。SPY は保有するのが非常に安く、SPY の驚異的な取引量により、戦術的トレーダーやママ&ポップの投資家にとって完璧な手段となります。

NASDAQ インデックスと QQQ ETF

一方、成長志向の株式の健全性に目を向けると、投資の世界の大多数は、最強の指標としてナスダックに向かっています。このインデックスは主にテクノロジーおよびインターネット関連企業に焦点を当てていますが、多くの金融、消費者、バイオテクノロジー、および産業企業も含まれています。グループの主要なインデックスであるナスダックコンポジットは、Apple (AAPL)、Intel (INTC)、Facebook (FB)、Microsoft (MSFT) を含む 3,300 以上の株式を追跡しています。

最後に、QQQ は、世界で最も確立され、最も取引されている ETF の 1 つです。また、これは最も珍しいものの 1 つです。インデックスのルールに従って、ファンドは NASDAQ に上場している非金融株にのみ投資し、他のセクターも事実上無視しているため、広範な大型株ポートフォリオから大きく外れています。QQQ には膨大な技術露出がありますが、純



粋な意味での「技術基金」でもありません。基金の不可解な重み付けルールは、単純なバニララージキャップまたは純粋なプレイ技術カバレッジに近いものからさらに距離を置いています。ETFはその上位保有にはるかに集中しており、比較的不安定です。それでも、それは非常に大きくて流動的であり、基礎となるインデックスである NASDAQ-100 に大きな名声を与えています。

2019年の市場の変動と変動

検討期間中、主要な世界市場は大きな混乱を経験したため、すべてのセクターでボラティリティが増大したため、S&P 500 と NASDAQ、および上記の ETF の両方で、価格はほとんどすべての地域でほとんど予測できませんでした。その結果、投資家やアナリストのコミュニティから、信頼性の高い一貫した予測アルゴリズムの需要が急増しています。一方、I Know First 予測アルゴリズムはこれらの資産の毎日の予測を提供し、次のセクションではこれらの予測の顕著な結果をさまざまな期間におけるヒット率の観点から提示します。以下のチャートは、分析されたインデックスと ETF が過去半年間に経験したボラティリティを示しています：







株式市場の予測ヒット率の評価



Hit Ratio Per Time Horizons					
Index/ETF	3 Days	7 Days	14 Days	1 Month	3 Months
^IXIC	67%	72%	79%	79%	92%
QQQ	68%	74%	79%	79%	97%
^S&P500	60%	68%	78%	73%	77%
SPY	65%	69%	77%	79%	87%

上記の結果から、I Know First がさまざまな期間にわたって S&P 500 と Nasdaq を一貫して予測できるアルゴリズムを開発したことがわかります。2019 年までの平均で、I Know First は、3 か月の予測期間の 87% の時間で S&P 500 を追跡する ETF の正確な動きに到達するという驚くべき偉業を達成しました。それに加えて、このファンドの 3 日間の期間、7 日間の期間、14 日間の期間、1 か月の期間をそれぞれ 65%、69%、77%、79% の精度で予測できます。一方、機械学習アルゴリズムは、Nasdaq に続く ETF の動きをさらに速い速度で一致させることができました。具体的には、3 日、1 週間、14 日、1 か月、3 か月の期間で、アルゴリズムは ETF を 68%、74%、79%、79% で正しく予測しました。それぞれ 97%。これにより、投資家は、これらの迅速かつ不安定な期間にもかかわらず、投資する際により安全な見通しを持つことができます。





結論

全体として、I Know First の使命は、クライアントに未来に関する最高の情報を提供することです。信じられないほどの人工知能システムを介して S&P 500 および Nasdaq インデックスおよび関連する ETF を予測する能力を強化することにより、お客様の投資がより安全で収益性の高い確実性を提供します。確実性の範囲内で、S&P 500 と Nasdaq の両方の動きを過去半年間の最大 97% の時間まで予測できることを一貫して見つけることができました。さらに、ヒット率 (成功の一貫性) とリターン率 (成功の大きさ) の両方の観点から、各インデックスを追跡する ETF を予測する精度がさらに向上しました。