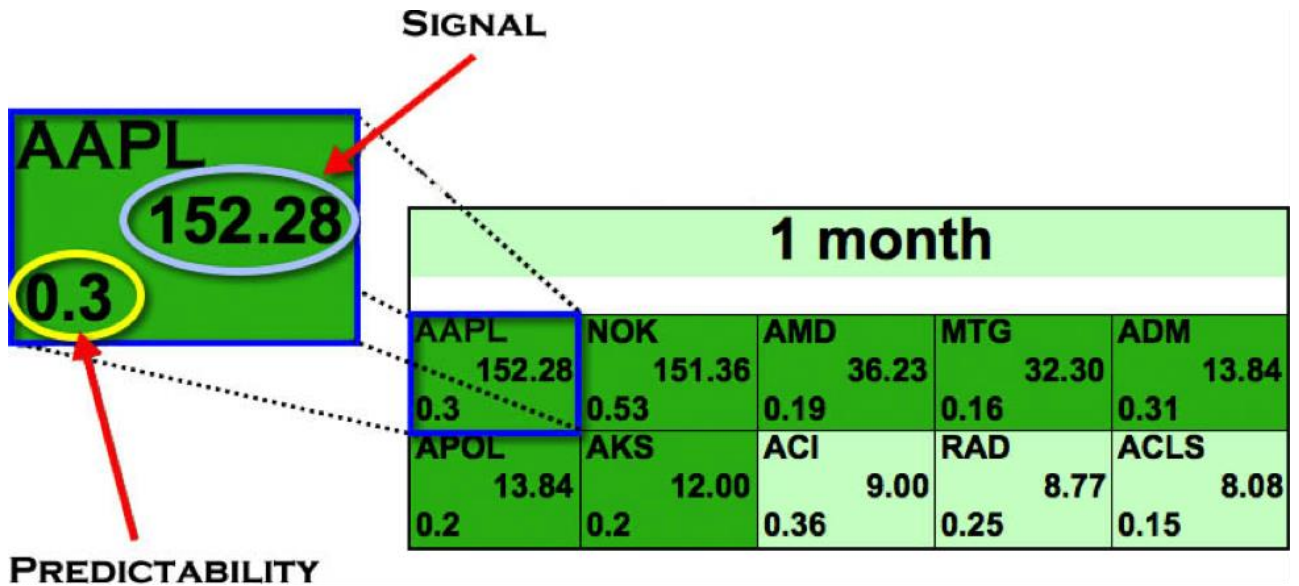


アルゴリズム取引のヒント: ヒートマップのインジケータを読む

2014年12月21日



上記の表の一番上の行は、Appleの株式のティッカーシンボルである「AAPL」を示しています。ほとんどすべての取引資産には、それを識別するティッカーがあります。商品は、株式と同様に、ティッカーシンボルを使用して識別されます。金はXAUで表され、ティッカーGLDで識別されるSPDRゴールドトラストETFとして一般的に取引されています。通貨ペアは2つの通貨記号で識別されます。たとえば、USD / EURは、ペアが米ドルとユーロを指していることを示しますが、シグナルは常にペアの最初の通貨に適用されます。

Signal : ミドルライン(信号強度)

信号は予測された動きの方向または傾向を表し、パーセンテージまたは特定の目標価格ではありません。信号強度は、現在の株価がシステム均衡または「公正な」価格と見なすものからどれだけ逸脱しているかを示します。信号には、ポジティブ(予測される増加)またはネガティブ(予測される減少)の符号があります。ヒートマップは信号強度に応じて配置され、上が最も強い信号が上に、下の信号が弱くなります。表の色は信号を示しています。緑はポジティブの信号に対応し、赤はネガティブの信号を

示します。色が濃いほど信号が強くなり、色が薄いほど信号が弱くなります。時間範囲が長くなると、信号強度も大きくなります。より強いシグナルは、それらが株式、通貨、商品、またはインデックスを参照しているかどうかに関係なく、価値が増加する可能性が高いことを示します。

Predictability : 結論(予測可能性)

予測可能性指標は、信号の重要性を測定します。予測可能性は、予測とその特定の資産の実際の市場動向との間の過去の相関関係であり、毎日再計算されます。理論的には、予測可能性はマイナス 1 からプラス 1 の範囲です。この数値が高いほど、特定の資産の予測可能性が高くなります。異なる時間範囲の予測可能性を比較すると、時間範囲が長いほど予測可能性が高いことがわかります。これは、長距離信号がより正確になる傾向があることを意味します。一般に、0.3 を超える予測可能性は、非常に高い信頼水準です。

トップ 10+ S&P500 とは何ですか？

最も人気のある製品の 1 つである「[トップ 10+ S&P500](#)」は、市場開放前に毎日送信されます。この予測には、3 日、7 日、14 日、1 か月、3 か月、および 1 年の期間の 6 つのヒートマップが含まれています。各ヒートマップは、数千のプールからの資産信号強度に従って分類されます。上位 10 個の信号が上部に表示され、下位 10 個の信号が下部に表示されます。S&P500 予測は、信号強度に関係なく、信号と予測可能性を示します(つまり、下位 10 位または上位 10 位である必要はありません)。この機能は株式でも利用できます。特定の資産を常に追跡し、上位 10 を引き続き取得したい場合は、お問い合わせ下さい。