

アルゴリズム取引のヒント: ヒートマップから情報を導き出す

2014年12月7日

I Know First の一般的な製品は一定数の株式を提供しております。例えば、ハイテク株の予測では、Long(購入)する上位 10 銘柄と、Short(売り)する下位 10 銘柄のみが表示されます。表には S&P 予測が含まれていないため、一般的な市場の方向性がないことを意味するものではありません。下の表は、ハイテク株の市場全体が上昇する可能性が高い予測を示しています。したがって、インデックス予測は(パッケージに含まれていなくても)ポジティブであると想定し、結果は S&P500 が 1 年以内に 13.52% 上昇したことを示しています。

Algorithmic Stock Forecast

Updated 17_Nov_2013						
MU	321.00	HPQ	125.27	ORBK	78.05	
0.02	0.49	0.33	72.45	ADM	0.33	
0.36	0.33	60.59	CHKP	28.89	CRM	22.10
0.47	0.41	0.21	22.09	YHOO	18.94	
0.69	0.26	10.35	170.29	170.12	161.49	
0.11	0.34	0.3	139.50	135.40	0.24	
0.56	128.94	125.27	117.59	101.55	100.91	
0.27	0.49	0.3	0.24	0.35	0.3	
94.28	78.05	72.45	71.15	60.59	0.33	
0.21	0.33	0.36	0.36	0.33	0.33	
51.31	46.68	42.69	39.46	38.16	0.2	
0.39	0.37	0.35	0.24	0.24	0.24	
36.01	34.41	32.99	32.99	31.82	0.38	
0.31	0.51	0.56	0.1	0.1	0.1	
28.89	28.68	28.35	27.76	27.49	0.47	
0.23	0.38	0.02	0.17	0.17	0.17	
27.17	26.74	26.09	25.66	25.01	0.19	
0.25	0.31	0.53	0.4	0.4	0.4	
23.07	22.42	22.42	22.10	22.09	0.21	
0.25	0.3	0.41	0.21	0.21	0.21	
20.97	20.38	20.11	19.14	18.94	0.17	
0.44	0.13	0.22	0.69	0.69	0.69	
18.73	18.11	17.90	17.31	17.03	0.38	
0.24	0.24	0.33	0.29	0.29	0.29	
16.82	16.49	15.56	15.52	14.81	0.27	
0.23	0.18	0.27	0.28	0.28	0.28	
13.91	13.37	13.26	13.04	13.03	0.16	
0.41	0.28	0.31	0.3	0.3	0.3	
12.94	12.77	12.51	12.29	11.43	0.2	
0.22	0.4	0.71	0.57	0.57	0.57	
11.43	11.12	10.83	10.78	10.78	0.33	
0.18	0.28	0.27	0.25	0.25	0.25	
10.39	10.35	9.70	9.63	9.57	0.31	
0.26	0.49	0.1	0.23	0.23	0.23	
9.49	9.27	8.62	8.41	8.35	0.17	
0.42	0.29	0.27	0.24	0.24	0.24	
8.19	7.87	7.76	7.76	7.44	0.31	
0.13	0.31	0.19	0.48	0.48	0.48	
7.12	6.84	6.68	6.25	6.04	0.21	
0.03	0.34	0.3	0.19	0.19	0.19	
5.77	5.70	5.61	5.55	5.44	0.1	
0.55	0.26	0.26	0.43	0.43	0.43	
5.39	5.29	5.18	5.18	4.96	0.27	
0.4	0.21	0.23	0.32	0.32	0.32	
4.96	4.80	4.74	4.48	4.31	0.24	
0.3	0.1	0.4	0.21	0.21	0.21	
-33.20	-34.28	-36.65	-37.52	-39.46	0.3	
0.32	0.28	0.34	0.28	0.28	0.28	
-45.93	-50.34	-68.13			0.33	
0.32	0.3				0.33	

Forecast Performance

Symbol	Forecast	% Change	Accuracy
	November 17th	November 17th	
MU	↑	65.93%	✓
HPQ	↑	51.27%	✓
ORBK	↑	11.06%	✓
ADM	↑	30.27%	✓
PCRFY	↑	15.55%	✓
CHKP	↑	22.38%	✓
CRM	↑	9.07%	✓
AMAT	↑	31.00%	✓
YHOO	↑	47.65%	✓
EMC	↑	28.62%	✓
I Know First Average		31.28%	✓
S&P 500		13.52%	

Ticker	Recommended Long Position: ↑
Signal	Recommended Short Position: ↓
Predictability	*I Know First Average denotes the non-weighted average return of the listed symbols

上記表の全ての株のうち、ネガティブなシグナルを示したのはごくわずかでした。また、強気のシグナルは弱気よりもはるかに強く、市場の想定が高まりました。これは投資する絶好の機会です。逆の場合のテーブルは次のようになります。

Algorithmic Stock Forecast

Forecast Performance

3 months Updated 18 Jul 2014				
165.08	146.08	135.39	112.83	97.39
0.25	0.52	0.51	0.39	0.26
79.57	65.32	65.32	62.95	62.95
0.24	0.22	0.21	0.52	0.48
57.01	57.01	55.82	54.63	54.63
0.37	0.39	0.24	0.6	0.23
47.51	42.76	40.38	39.19	38.01
0.44	0.21	0.48	0.23	0.25
33.25	32.07	28.50	27.32	26.13
0.63	0.57	0.24	0.23	0.59
11.88	10.69	9.50	9.50	8.31
0.25	0.28	0.47	0.45	0.24
7.13	5.94	5.94	4.75	4.75
0.22	0.55	0.46	0.19	0.3
3.56	3.56	3.56	2.38	2.38
0.3	0.27	0.27	0.56	0.34
1.19	1.19	-1.19	-3.56	-5.94
0.37	0.22	0.21	0.62	0.24
-5.94	-8.31	-8.31	-10.69	-11.88
0.25	0.22	0.26	0.22	0.25
^S&P500	-13.06	-13.06	-13.06	-22.57
0.24	0.27	0.23	0.21	0.59
-26.13	-26.13	-26.13	-27.32	-33.25
0.21	0.22	0.24	0.27	0.52
-33.25	-34.44	-34.44	-35.63	-39.19
0.27	0.22	0.26	0.5	0.23
-40.38	-41.57	-42.76	-47.51	-48.69
0.25	0.22	0.21	0.26	0.48
-49.88	-54.63	-54.63	-58.20	-61.76
0.19	0.51	0.23	0.22	0.58
WFT	IBN	MEG	X	FCX
-64.13	-68.51	-71.26	-80.76	-87.88
0.46	0.22	0.25	0.55	0.24
MT	TWX	YZC	ATI	AA
-111.64	-118.77	-141.33	-143.71	-184.08
0.25	0.49	0.59	0.22	0.29

Symbol	Forecast	% Change	Accuracy
	July 18th	October 18th	
WFT	↓	-27.70%	✓
IBN	↓	6.04%	✗
MEG	↓	-35.08%	✓
X	↓	26.43%	✗
FCX	↓	-20.39%	✓
MT	↓	-17.00%	✓
TWX	↓	-11.56%	✓
YZC	↓	8.01%	✗
ATI	↓	-26.80%	✓
AA	↓	-4.35%	✓
I Know First		10.24%	✓
Average		10.24%	✓
S&P 500	↓	-3.64%	✓

Ticker	Recommended Long Position: ↑
Signal	Recommended Short Position: ↓
Predictability	*I Know First Average denotes the non-weighted average return of the listed symbols

ここでは、テーブルは約半分強気と半分弱気に分かれています（特定の資産を見る必要はなく、シグナルだけを見る必要があります）。さらに重要なことに、「トップ 10 株+ S&P500」は実際にインデックスの予測を提供します。つまり、市場全体が下落すると予測され（信号強度-13.06）、強気になること

で市場全体に対して投資します。さらに、ここでは弱気のシグナルが強いことがわかります。これは、株式をショート(売り)する機会を提供します。あるいは、市場が良くなったときにポジションを終了して再度投資する機会を提供します。一部の投資家は、ゴールドや通貨などのまったく異なる市場にジャンプします。

すべての機関投資家、および一部の個人投資家は、特定の株式のポジションを常に見たいと考えています（トップ 10 またはボトム 10 にない場合でも）。1 年間のコミットメントで、上位 10 銘柄と下位 10 銘柄だけを取得するのではなく、チャート上のどこにいても無料で 10 銘柄の位置を取得できます。詳細については、お問い合わせ下さい。