



Time series prediction 연구 계획2

Tae-Won Lee,
leetee95@gmail.com
2020. 08. 03.

Introduction

- Data

- high frequency trading을 위한 데이터로 1분 단위 데이터 사용

- Kaustubh Khare, Omkar Darekar, Prafull Gupta, V. Z. Attar. Short Term Stock Price Prediction Using Deep Learning IEEE International Conference on Recent Trends in Electronics, Information & Communication Technology (RTEICT) (2017).

- Zineb Lanbouri* , Said Achchab. Stock Market prediction on High frequency data using Long-Short Term Memory. International Workshop on Artificial Intelligence & Internet of Things (A2IoT). (2020)

Introduction

- 데이터 수집을 위한 증권사 API 이용
 - 키움증권, 대신증권, 이베트스투자증권 등에서 API를 이용한
분 단위 주가 데이터를 제공.
 - 키움증권의 데이터는 현 시점으로부터 2년 전까지의 데이터가 이용가능.
 - 현 시점으로부터 5년 전 데이터가 이용가능한 대신증권 API 이용

Introduction

- 증권사 API 이용 ISSUE

- 국내 모든 증권사 API는 python3.7 버전, 32bit 환경에서 작동 가능.

- 32bit 환경에서 정상적인 연결을 확인.

- 현재 사용중인 pytorch환경과 증권사 api의 동시

사용을 위해 32bit, 64bit 환경 간의 통신이 필요하여

추후 구현이 필요.

```
...: import win32com.client as wc
...:
...: objCpCybos = wc.Dispatch("CpUtil.CpCybos")
...: bConnect = objCpCybos.IsConnect
...: if bConnect == 0:
...:     print("PLUS가 정상적으로 작동하지 않음")
...:     exit()
...:
In[3]: bConnect
Out[3]: 1
```