

ỨNG DỤNG LUẬT KẾT HỢP TRONG KHAI PHÁ DỮ LIỆU CHỨNG KHOÁN

APPLYING ASSOCIATION RULES IN STOCK DATA MINING

Tác giả: Nguyễn Văn Chức*, Nguyễn Hữu Phi

Tóm tắt bằng tiếng Việt:

Thị trường chứng khoán Việt Nam đang phát triển mạnh mẽ trong những năm gần đây. Với số lượng các công ty niêm yết trên thị trường chứng khoán tăng nhanh chóng đã thu hút rất nhiều nhà đầu tư. Cùng với sự phát triển mạnh mẽ của thị trường chứng khoán, khối lượng dữ liệu sinh ra từ giao dịch chứng khoán không ngừng tăng lên một cách nhanh chóng theo thời gian. Trong khối lượng dữ liệu khổng lồ này, chứa đựng nhiều tri thức tiềm ẩn rất có giá trị đối với các nhà đầu tư chứng khoán. Bài báo này tập trung nghiên cứu về kỹ thuật luật kết hợp trong khai phá dữ liệu và ứng dụng kỹ thuật này nhằm phát hiện các tri thức tiềm ẩn (các mối quan hệ, tương quan) về thay đổi (tăng, giảm) giá và khối lượng giao dịch của các mã chứng khoán. Dựa vào các tri thức phát hiện được từ mô hình khai phá dữ liệu, một công cụ sẽ được xây dựng nhằm hỗ trợ cho các nhà đầu tư chứng khoán ra quyết định một cách hiệu quả và tin cậy hơn.

Từ khóa: chứng khoán; khai phá dữ liệu; luật kết hợp; mô hình dự đoán; giao dịch.

Tóm tắt bằng tiếng Anh:

Vietnam stock market has been developing strongly in recent years. The rapid increase in the number of fast-growing companies posted on the stock market has attracted more investors. As a result, the volume of data generated by stock transaction continues to grow rapidly. The large data volume contains a lot of potential information that is useful to security investors. This paper focuses on studying association rule technique in data mining to apply this technique to discover potential knowledge (relationships, correlations) about the change (increase, decrease) of prices and transaction volume among stock codes. Based on the knowledge discovered from data mining model, we have built a tool to support security investors in making wise and reliable decisions.

Key words: stock; data mining; association rule; predictive model; transaction