



**ICT**

**XGBoost**


 Reuniware Systems

Reuniware Systems
 
 1.0.6
 —
 2026-07-19
 
 PyPI:
 <https://pypi.org/project/inelida-marketscan>
 |
 GitHub:
 <https://github.com/reuniware/InelidaMarketScanner>

00

```
00000000000000060000000000000000InelidaMarketScan0000000ICT00000000
UhlenbeckHurstGARCHMonte CarloKelly0000000v1800001,2100000064.0%0000000027
Blocks00000000000000MI% > 50%00000000000000000000000000000002 270000
```

1. □□□□

## 1.1 背景

000000000000000000000000000000000000000000000Michael Huddle-  
ston00000000CT0000000000000000000000000000000000000000000000000

## 1.2 背景

- 8000000M500MN00ICT0000000000000000000002.  
0000000000001230000000000ML0000000000003. 000000002025-  
202600000000000000000000000004. 0000000000OU0Hurst0GARCH0Monte  
Carlo0Kelly000000005. 00000000 > 1.5000000

## 2. ICT環境

[illegible][illegible]

### 3. 特徴抽出

Diamondデータセットから特徴抽出を行う。

| 特徴  | Tenkan | Kijun | Kumo | T/K Cross | Flat History |
|-----|--------|-------|------|-----------|--------------|
| M5  | X      | X     | -    | X         | -            |
| M15 | X      | X     | -    | X         | -            |
| M30 | X      | X     | -    | X         | -            |
| H1  | X      | X     | X    | X         | X            |
| H4  | X      | X     | X    | X         | X            |
| D1  | X      | X     | X    | X         | X            |
| W1  | X      | X     | X    | X         | X            |
| MN  | X      | X     | X    | X         | X            |

### 4. Diamondデータセット

Diamondデータセットは100000個のデータセットである。

| 特徴               | 特徴 | 特徴                          |
|------------------|----|-----------------------------|
| H1-D1            | 24 | Kijun/TenkanとKumoとのクロス      |
| W1-MN            | 8  | Kijun W1/MNとKumo W1/MNとのクロス |
| FVG              | 12 | M5とD1のFVGの長さ                |
| OB               | 12 | M5とD1のOBの長さ                 |
| BOS              | 18 | M5とD1のBOSの長さ                |
| HVN/LVN          | 12 | M5とD1のHVN/LVNの長さ            |
| BRK              | 12 | M5とD1のBRKの長さ                |
| AH/AL            | 4  | AH/ALの長さ                    |
| scale_pos_weight | 5  | scale_pos_weight            |
| M30/M15/M5 Kijun | 2  | Kijun M30/M15/M5            |

特徴抽出: 109 特徴抽出

### 5. データセット

MLデータセットは30000個のデータセットである。

| 特徴 | 特徴            | 特徴                             |
|----|---------------|--------------------------------|
| 1  | ml_labeler.py | DiamondデータセットのDB/CSV/特徴抽出      |
| 2  | ml_trainer.py | 50000個のデータセットのscale_pos_weight |

| 行 | 列               | 内容                                                               |
|---|-----------------|------------------------------------------------------------------|
| 3 | ml_predictor.py | extract_features()<br>→ predict_proba() →<br>MLPredictor(500000) |

## 6. XGBoost v18 —

v1800000000000000GARCH0000000001230000000001,210000000000

| □□□□□□□□□□       | □          |
|------------------|------------|
| max_depth        | 6          |
| learning_rate    | 0.03       |
| n_estimators     | 200        |
| subsample        | 0.8        |
| min_child_weight | 3          |
| gamma            | 0.1        |
| reg_alpha        | 0.5□L1□    |
| reg_lambda       | 1.0□L2□    |
| scale_pos_weight | □□□□□□□□□□ |

**123**000000000000000000000000/00000600Kijun                  6TF01800Tenkan  
6TF01800T/K0000600Kumo0600M5/M15/M300000120000000002000000FVG010000000000600  
Carlo0GARCH000003000000000300

## 7. □□□□□

27 XGBoost

| Model | Series    | Estimates     | DF    | CV     | OOS PF   |
|-------|-----------|---------------|-------|--------|----------|
| v1    | 600000    | 36            | 852   | 61.0%  | —        |
| v4    | 1300000   | 111           | 1,210 | 62.9%  | 1.26*    |
| v7    | 1300000   | 25000         | 2,923 | 60.1%  | 1.173    |
| v13   | 4000/100  | 25            | 2,923 | 53-64% | 4.000    |
| v15   | 2025-2026 | 25 + OU/Hurst | 5,009 | 59.8%  | —        |
| v18   | 1300000   | 1230 GARCH    | 1,210 | 64.0%  | 0.503 F1 |

## 8. □□□□□□v4□

[illegible]







