[CD1\_10주차 진행 상황 보고서]

개발 제목 : Smart Beta (주식시장을 이기는 똑똑한 투자전략)

팀명 : Quant

팀원 : 홍성주, 임하늘이, 박유영, 이수진

소속 : 컴퓨터공학과

이메일 : [esj0380@naver.com](mailto:esj0380@naver.com)

1. 저번 주 진행 상황

- 데이터 오류에 대한 대체 방안을 마련하여 방안에 따른 프로젝트 진행

1. 이번 주 진행 상황

- 프로젝트를 진행하면서 데이터를 분석하기에 편리한 함수를 만들었다.

- 지난주에 오류가 난 PBR지수와 관련되지 않은 전략을 결정하였다. 변동성 지수와 관련된 high risk high return 전략 (위험이 클수록 수익률이 높아짐)

- 미국 주식시장의 변동성이 적을수록 수익률이 높다는 전략이 한국 시장에서도 발생하는지 실증 분석을 하여 알아봄.

- 성과분석을 통해 변동성이 낮은 분위가 수익률이 높은 것을 알 수 있음. 그 결과, 40개의 주식을 사는 것이 수익을 많이 낼 수 있음을 보고 우리는 40개의 주식 종목을 추천할 예정이다.

(3) 차주 계획

- Low Risk Low Return 전략에 따른 주식 추천종목 40개를 추출 후 다음 전략 계획.