[CD1\_4주차 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

* 구현할 웹페이지 구성도 작성
* 2차례의 경제 투자 스터디 진행
* 금융 데이터를 제공해주는 회사 fnguide를 이용해서 엑셀 데이터(2000만개)를 다운받음.

1. 이번 주 진행 상황

-노벨 수상자 (Fama-french)의 논문을 이용해서 (MKT, SMB, HML, RMW, 등) 총 5가지 주식의 수익률 이해

- 위의 전략과 MOM 팩터를 추가시켜 한국시장에 적용했을 경우의 성과 분석.

- Handa Partner 에서 한국버전 다운로드 csv파일 2개를 읽고 시계열 일정하게 한 후 분석과정을 통해 유의미한 결과를 가진 것 선택.

(3) 차주 계획

- 5가지 요인과 관련된 전략 정보 검색과 데이터 모으기

- 수집된 데이터로 전략 별 분석.