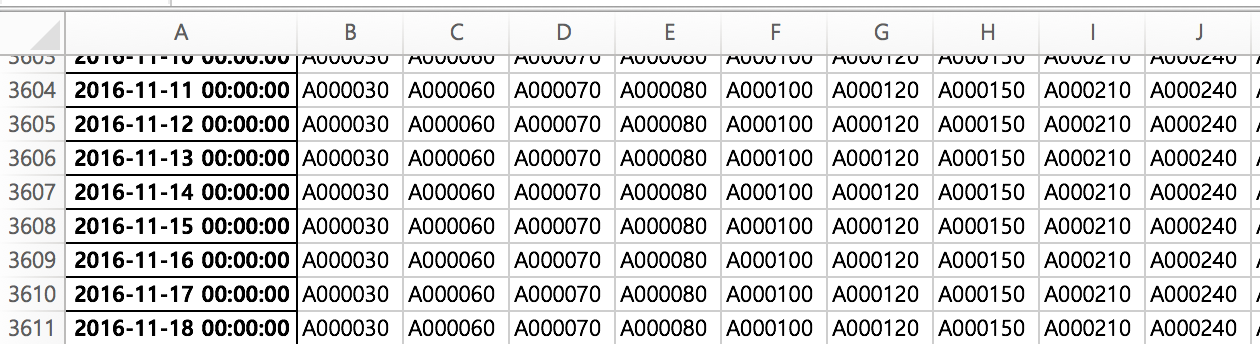
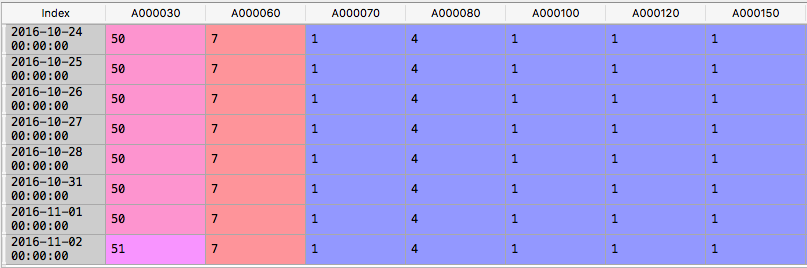
백테스트 관련

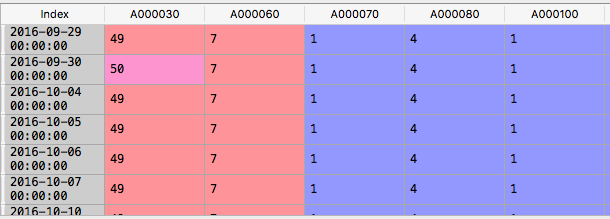
1. 생존편의 -> 매기간 투자 대상으로 하는 Universe를 복원하여 그 중에서 종목 선택을 함



1. 투자 “비율”이 아닌 주식 갯수는 “정수”로



1. 포트폴리오 종목 선정과 진입 시점에 적절한 시차두기



(ex, 위에서 9월말에 뽑힌 종목을 9월말에 바로 진입한다든가, 10월 첫째날에 진입한다는 식으로 백테스트를 진행하면 수익률이 왜곡될 수 있음. 10월 1, 2, 3 일은 휴일이었기 때문에 월말 종목 선정, 월초 진입하는 전략을 시뮬레이션 한다면 이를 고려해야함)

1. 2번과 연관지어서, 주식 보유 갯수를 정수로 맞추다보면, 투자 되지 못하고 남는돈이 적지 않은 비율을 차지할 수 있음. 이로 인해서 투자 수익률이 왜곡될 수 있음  
   (ex, 정수 반올림 문제로 배정금액 1억원 중 7천만원만 투자 되었을 시, 7천만원 투자금액 중 5% 수익률이 났다고 한다면 이는 총 금액 대비 3.5% 정도의 수익률로 봐야함. 하지만 이는 학생투자펀드 운용방향과 맞지 않음. 자산 배분은 투자전략팀이 하고 각팀은 배정받은 금액 모두를 투자)
2. 계좌별로 거래비용이 다름. 이를 고려해서 현실적으로 거래비용 고려

