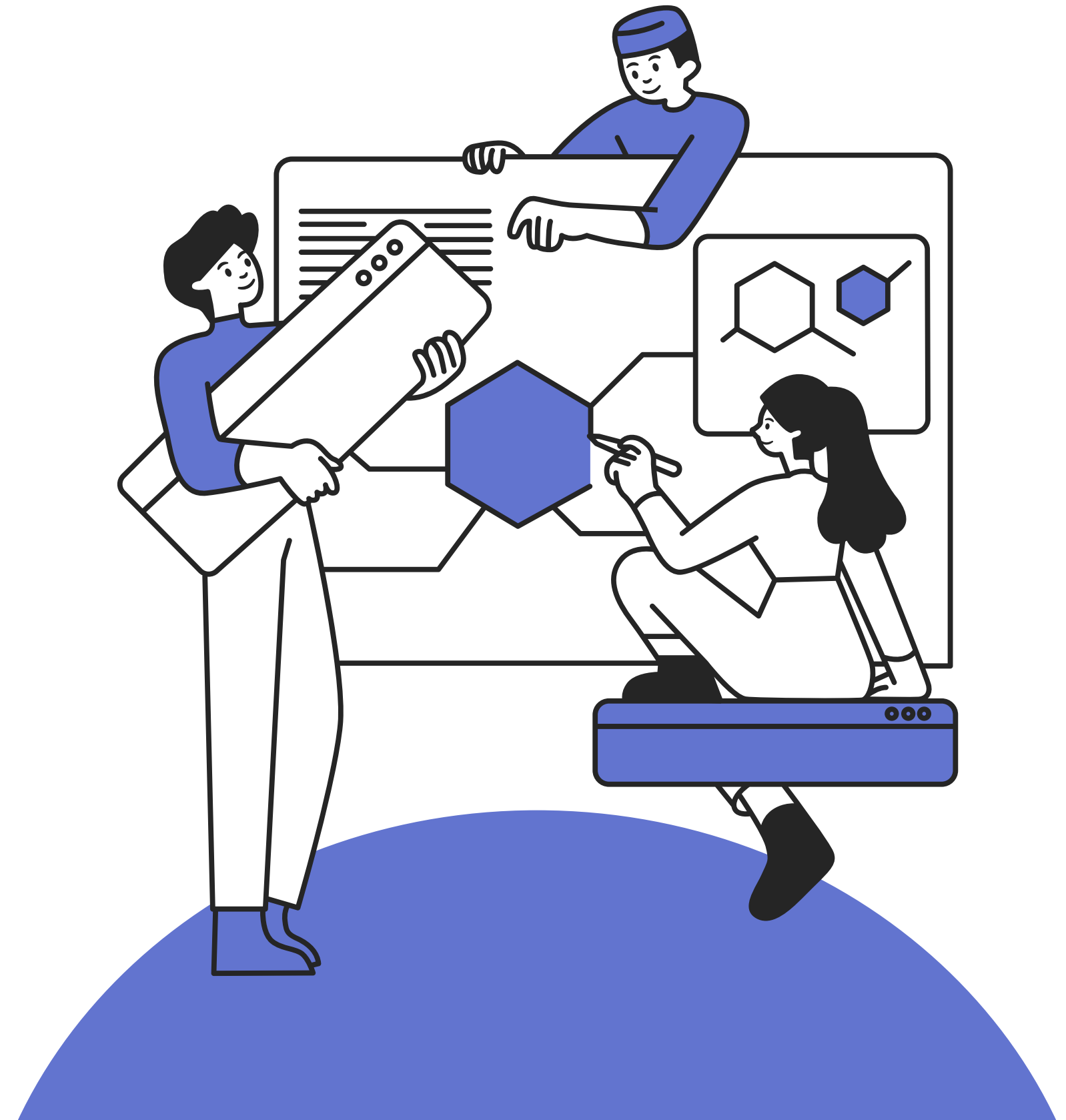


# 고객의 돈을 복사해주는 최적의 펀드상품 개발

- 재무데이터를 중심으로

숫자의 마법사들

김보윤, 정승원, 김성현, 김도현, 장규민



# CONTENTS

1 개요

2 배경 및 문제 정의

3 목표 및 기대 성과

4 투자 전략 설명

5 데이터 수집 방법

6 프로젝트 진행 계획

7 팀 구성

8 Q & A

# 01 개요

# MATW

## < 숫자의 마법사들 >

“우리는 데이터와 숫자, 그리고 분석의 힘을 믿습니다.”

“숫자라는 언어로 투자 세상을 해석하고,  
데이터 기반의 새로운 투자 전략을 제시하는 것이 우리의 미션입니다.”



마치 마법사가 다양한 재료를 조합해 특별한 결과물을 만들어내듯,  
방대한 금융 데이터와 수리적 분석 기법을 결합하여 기존과는 차별화된 투자 전략을 제시합니다.

## 02

# 배경 및 문제정의

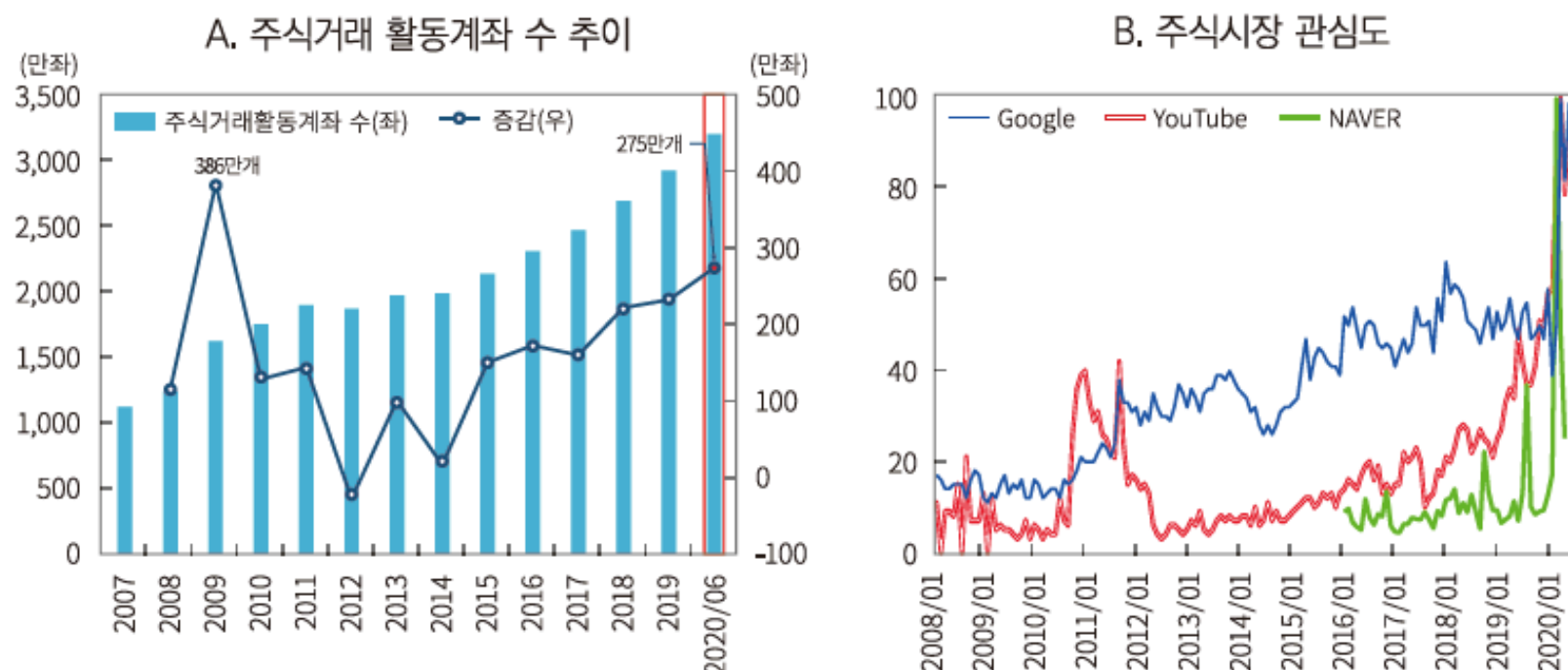
"이젠 은행에서 주식시장으로" CMA 잔액 역대 최대

‘K 밸류업’이 곧 한국경제 미래…구조개혁으로 펀더멘털 강화해야 [자본중심 K밸류업⑤]

입력 2024-09-03 16:00



〈그림 1〉 주식거래 활동계좌 수 및 주식시장 관심도 추이



주 : 그림1-B는 '주제어: 주식(stock)'의 구글 웹 검색(Google) 및 유튜브 검색(YouTube) 트렌드와 네이버 주식시장 관련 검색어(주가, 주식시장, 주식투자, 코스피, 코스닥) 트렌드를 나타냄

자료: 금융투자협회, 구글 트렌드(trends.google.co.kr), 네이버 데이터랩(datalab.naver.com), 저자 계산

## MZ 세대의 주식 열풍 '주린이' 증가

김수지 기자 | 입력 2021.02.24 10:14 | 댓글 0 | 취재보도부

‘영끌’, ‘빚투’ 등 주식 관련 다양한 신조어 생겨  
단기 투자보다는 5년 이상의 장기 자금으로 투자하는 게 안전

# 03

## 목표 및 기대성과

기존에 존재하지않는 새로운 지표 개발



지표를 활용한 투자전략 수립/강화

기존 펀드상품보다 나은 수익률



연 10% 이상의 수익 목표

백테스팅 결과 시각화 서비스



streamlit을 활용한 동적 대시보드

# 04

## 투자 전략 설명 (재무 데이터를 활용한 투자 지표 예시)

### ex1) GYP비율 전략

John B. Neff의 GYP비율 전략

$$\text{GYP 비율} = \frac{\text{당기순이익 증가율(Growth)} + \text{배당수익률(Dividend Yield)}}{\text{주가수익비율(PER)}}$$

2 이상인 경우를 투자 기준

→ 당기순이익 증가율 대용치 : ROE

### ex2) CAN SLIM 법칙

William J. O'Neil CAN SLIM 법칙

The Successful Inv

- **C (Current Earnings):** 현재 주당 분기 순이익 (증가율)
  - 분기 순이익 증가율이 20~50% 이상인 기업에 투자
- **A (Annual Earnings increases) :** 연간 순이익 증가율
  - 연간 순이익 증가율이 25% 이상, 3년 순이익 증가율이 안정적인 기업, 자기자본이익률이 17% 이상인 기업에 투자
- **N (New) :** 신제품, 경영혁신, 신고가
  - 신제품, 신경영, 신고가를 형성하는 기업에 투자
- **S (Supply and Demand) :** 수요와 공급
  - 유동주식수가 적은 종목을 공략
- **L (Leader or Laggard) :** 주도주와 소외주
  - 시장 주도주를 사고 소외주를 피한다.
- **I (Institutional Sponsorship) :** 기관 관심주
  - 기관이 관심을 맞는 종목에 투자
- **M (Market Direction) :** 시장의 방향
  - 보조지표나 시장속보 등 전문가의 견해를 의지하는 것 보다는 매일 주가지수의 움직임을 체크하며 자신만의 노하우로 시장 움직임을 파악하는 것이 중요

(참고)

- 시가총액 100억 이상
- EPS 증가율 최근3년 평균 기준 25% 이상
- 3일봉 연속 외국인 순매수 발생 또는 3일봉 연속 기관 순매수 발생
- 최근 5일봉이내 260봉 신고가 갱신
- 제외종목 : 관리종목, 거래정지종목, 정리매매종목, 불성실공시종목, 투자위험종목, 우선주

# 05

## 데이터 수집 방법

01

pykrx 라이브러리

ohlcv 데이터

수급 데이터

기술적 지표 데이터

02

ts2000

재무상태표

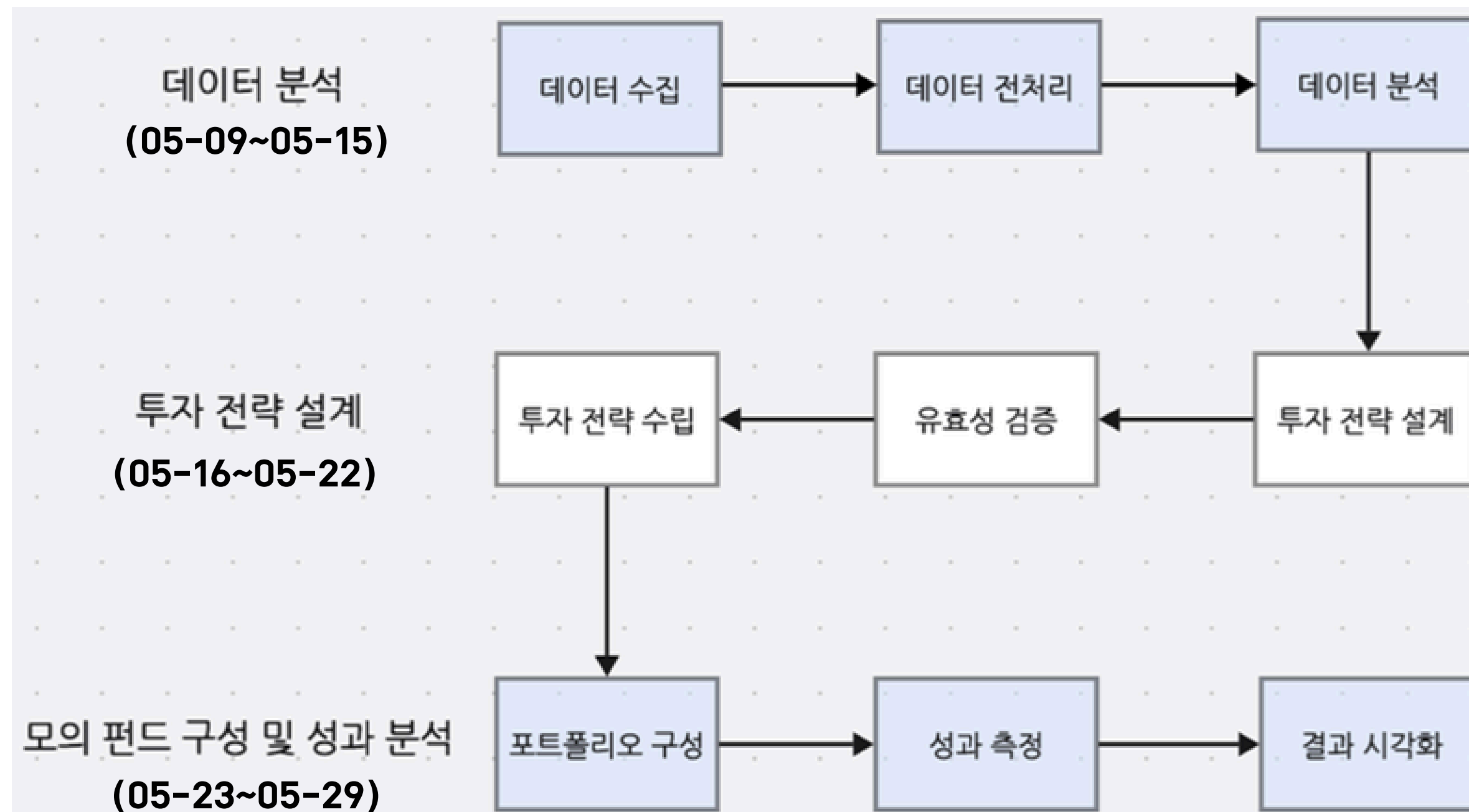
포괄손익계산서

현금흐름표

자본변동표

# 06

## 프로젝트 진행 계획





# 07

## 팀 구성

김보윤 : 팀장, 대시보드 구축

정승원 : 투자전략 코드구현

김성현 : 데이터 구성 및 전처리

장규민 : 투자지표를 활용한 전략 구성

김도현 : 데이터 분석 모델링 및 검증



Magicians Of Number

08

**Q & A**

# THANK YOU

---