**경제데이터분석입문 프로젝트 – Dashboard 설명**

퀀트응용경제학과

이성규

**1. 좌측 사이드바**

- 포트폴리오를 구성할 ETF 티커, 투자비중 입력

- 시뮬레이션 시작 및 종료 시점 지정, 최근 데이터까지 또는 지정기간 설정 가능

- 포트폴리오 수익률 데이터 시계열 주기(월간, 일간) 설정, 리밸런싱 주기(연간, 분기, 월간, 주간) 설정

- 야후 파이낸스(<http://finance.yahoo.com>) 에서 관련 데이터 가져옴

- Submit 버튼 누르면 데이터 다운로드 및 시뮬레이션 실행되고 결과값이 각 페이지에 출력됨

**2. Portfolio Strategy Simulation**

- 사이드바에서 세팅된 포트폴리오 누적성과 차트, Risk/Return Profile, 연간성과 등 성과분석 결과 시각화

**3. Portfolio Optimization**

- 사이드바에서 세팅된 ETF 유니버스를 활용하여 포트폴리오 최적화 기법을 통해 포트폴리오 구성 및 비중 제시

- Random Portfolio 숫자 입력 🡪 효율적투자곡선 하에 Max Sharpe 포트폴리오, Min Variance 포트폴리오 도출

- 이후 코너해 방지를 위한 제약조건을 최적화 과정에 추가할 예정

**4. Asset Performance Analysis**

- 사이드바에서 세팅된 각 자산군 ETF의 누적성과 및 상관관계 등 요약 및 시각화

**5. [TAA] OECD CLI Strategy**

- OECD CLI 지표를 기반으로 경기국면을 판단하고 주식 및 채권에 비중을 배분하는 EMP 전략의 성과를 백테스팅하고 결과 시각화

- OECD 홈페이지에서 경기선행지수 시계열 데이터 다운로드

**6. [TAA] Adaptive Asset Allocation**

- 11개 내외의 글로벌 주요 자산군을 유니버스로 하여, 모멘텀 스코어 기반으로 투자대상 ETF 선정 + 최소분산최적화 기법을 통한 포트폴리오 구성 전략

- 실행버튼 누르면 데이터 다운로드 및 백테스팅 실행 🡪 결과 시각화

**7. [Research] Quantitative Research**

- 실무적인 퀀트 리서치 페이퍼 등이 업데이트 되는 주요 사이트의 포스팅 리스트 정리

**8. 향후 활용 방안**

- ETF 기반의 다양한 퀀트 / 머신러닝 기반 투자전략을 지속적으로 리서치하고 데이터 분석하여 추가 및 정리해 나갈 계획임

- 다양한 ETF 유니버스 정보를 한눈에 볼 수 있는 페이지를 추가할 계획임

- 종합적인 EMP 포트폴리오 분석 시스템으로 지속적으로 발전시켜 나갈 계획임