**경제데이터분석입문**

2022710548 염보선

|  |
| --- |
| * **데이터 수집 계획서** |

* 1. **수집한 자료에 대한 간략한 소개**

**제목: 매크로 Dashboard**

|  |  |
| --- | --- |
|  | **내용** |
| 1. **TAA Analysis** | Benchmark 와 Portfolio 수익률 분석 및 개별 ETF의 시계열 그래프.  추가적으로 Portfolio와 BM의 수익률과 Vol, MDD 등을 볼 수 있는 탭을 업데이트하고 개별 ETF들의 기간 수익률 및 MDD도 작성하여 업무할 때 사용할 예정 |
| 1. **섹터 분석** | 섹터 1Week, 1M 수익률 및 섹터간 Correlation/시계열 Correlation  추후 3M, 6M, YTD 수익률을 한꺼번에 볼 수 있게 업데이트하고 시계열 Correlation 또한 왼쪽 slide에서 클릭하면 사용할 수 있게 업데이트 예정 |
| 1. **Liquidity & Vol** | 해당 탭은 Vix의 시계열자료를 통해 지속적으로 모니터링하고 과거와 비교할 목적으로 만듦  M2와 Market CAP /GDP 또한 유동성 및 valuation을 가늠하기 위한 지표로 활용할 예정 |
| 1. **경기선행지표 및 금리** | OECD선행지수를 통해 현재의 경기국면과 BEI10년물과 10Y treasury를 통해 금리 및 인플레이션을 측정하기 위한 목표로 만듦  IG Spread를 통해 회사채의 매력도 평가가능. |
| 1. **Valuation** | CAPE를 통해 현재의 Valuation 매력도가 어느정도인지 파악하고 Excess CAPE Yield는 인플레이션을 반영한 주가 수익률로서, 높을수록 주식이 매력적인 자산인데 아직까지 고평가수준임. |