Автоматизация формирования Macro View

# **Постановка задачи**

**Цель.** Автоматизировать еженедельное определение макро-взгляда США (Bull / Neutral / Bear) на горизонте ~6 месяцев на базе опережающих индикаторов и текстов релизов, с выпуском портфельной рекомендации (6L/4S, 5L/5S, 4L/6S) и динамическим списком лонг/шорт идей по подотраслям.

## **Индикаторы и входные данные**

* **Числовые серии (обязательно):** ISM Manufacturing PMI, ISM Services PMI (NMI), UMCSI, Real M2 (Billions of 1982–84 Dollars, M, SA), Yield Curve (как минимум 2s10s, 3m10y, плюс профиль кривой по срокам maturity как на графика в приложении), Building Permits (**раздельно**: Single-family и Multifamily, если влияет на выводы).
* **Тексты релизов:** ISM (manufacturing/services), UMCSI; по жилищному строительству — при наличии комментариев.
* **Календарь/частота:** еженедельно. Обновляем всё, что вышло на неделе; отсутствующие обновления берём из последней версии. Храним недельную динамику.

## **Политика пересмотров**

* Для текущей оценки используем **актуальные** пересмотренные числа.
* В истории храним **снимок “как было на дату”** (до пересмотра) **и** актуализированную версию — обе.

## **Сигналы и композит**

* **Весá индикаторов:** стартово **равные**; «тяжесть» будет подстраиваться позже с учётом текстовой корректировки и калибровки.
* **Правила порогов (база):**
  + ISM Manufacturing: использовать методологию ISM: **PMI > 42.3** «в целом соответствует росту ВВП»; детальные границы и маппинг в баллы уточним в проработке индикатора.
  + ISM Services: пороговая логика вокруг 50 (уточним при проработке).
  + UMCSI, Real M2, Yield Curve, Building Permits: пороги/тригерры задаём в проработке каждого индикатора (уровень, MoM/YoY, тренд, инверсия и её глубина, кривизна/склон).
* **Базовый балл по индикатору:** +1 / 0 / −1.
* **Текстовая корректировка:** применяется к базовому баллу на основе тональности и тематик (подотрасли). **Величину влияния (предел ±?) оставляем открытым для калибровки.**
* **Композитный скор:** сумма скорректированных баллов → **Bull / Neutral / Bear** (границы определим после калибровки на истории).

## **Выходы**

1. **Макро-взгляд недели:** Bull / Neutral / Bear.
2. **Портфельный маппинг (жёсткий):**
   * Bull → **6 Long / 4 Short**
   * Neutral → **5 / 5**
   * Bear → **4 Long / 6 Short**
3. **Список идей по подотраслям** (не только по секторам): динамическая длина (2+), ранжирование по силе сигнала, краткие обоснования (цифры + выдержки текста).
4. **Таблица диагностики:** по каждому индикатору — число, база, текстовая корректировка, итоговый сигнал, короткий комментарий, метки подотраслей.
5. **Экспорт:** Markdown/PDF **и** CSV/JSON.
6. **История:** недельные снапшоты чисел, текстового скора и итогов.

## **Процесс внедрения**

* **Этап 1 (ручная калибровка):** по мере выхода релизов последовательно обсуждаем **каждый индикатор**, фиксируем правила порогов, признаки тренда/ускорения, формулы сигналов, схему текстовой корректировки и маппинг подотраслей.
* **Этап 2 (автоматизация):** перенос правил в код, сбор данных по расписанию, генерация еженедельного отчёта.
* **Этап 3 (настройка весов):** корректировка весов и/или пределов текстовой корректировки по накопленной истории.

## **Открытые точки (уточняются в процессе ручной калибровки)**

1. **Предел влияния текста на балл индикатора.** Предлагаю протестировать три режима:  
   * Лёгкий: ±0.5
   * Базовый: ±1.0
   * Сильный: ±2.0  
      Выбери стартовый режим для пилота.
2. **Таксономия подотраслей.** Ориентируемся на GICS (с подотраслями) как базу? Если у тебя есть свой список (например, Homebuilders отдельно от REITs), пришли/подтверди.
3. **Порядок проработки индикаторов в Этапе 1.** Предлагаю начать с **Yield Curve** (еженедельная, уже есть график), затем **ISM Manufacturing**, **ISM Services**, **UMCSI**, **Building Permits (Single/Multi)**, **Real M2**. Устроит такой порядок?

Приложение

График 1. Yield Curve

