펀드 수익율 예측을 통한 포트폴리오 전략 수립

1. 종목선정(배제원칙):

* 성장성(매출액성장률, 영업이익성장률, 순이익성장률)
* 수익성(영업이익률, 순이익률, ROE, ROA, GP/A)
* 안정성(부채비율, 유동성 비율, 이자보상배율)
* 활동성(매출채권회전율)

2. 펀드분류 : 대형주/소형주, 성장주/가치주

- 중대형주\*성장주 : 시총 5천억 초과 \* PER 15배 초과

- 중대형주\*가치주 : 시총 5천억 초과 \* PER 10배 미만

- 중소형주\*성장주 : 시총 5천억 미만 \* PER 15배 초과

- 중소형주\*가치주 : 시총 5천억 미만 \* PER 10배 미만

3. 주가예측()

- 시계열

- LSTM(하루치 예측만 가능)

- 랜덤포레스트

- linear-regression

- Feature :

시가,종가, 저가, 고가

거래량/대금

금리

환율

경기선행지수

매수/도잔량

공매도 현황

신용비율

유가

4. 펀드별 Buy and Hold 수익률 확인

5. 포트폴리오 설정

6. 강화학습을 통한 A, B, C, D 혼합형 상품 개발