

# 돈벌어다 주는 인공지능

-비트코인 가격 예측 인공지능 샅질기-

AI 파트 정명진

# 자동사냥



# 원화 자동사냥

적은 돈으로 큰 불로소득을 얻을 수 있는 방  
법은 없을까?



적은 돈으로 큰 돈 만들기가 가능

24시간 열려 있음

뭔가 나도 부자가 될 수 있을 것 같음

주식에 비해 고려 할 사항이 적음

비트코인에 자동으로 투자하는 기계를 만들어 부자가 되자!

## 시스템 트레이딩

과거 데이터를 바탕으로  
매매규칙을 정해  
금융상품을 거래하는  
투자방법.

언제 살지

언제 팔지

미래의 가격을 예측하는 인공지능



인공지능으로 가격을 예측하고 트레이딩  
을 해보자

당시 내 머리 속



부푼 꿈을 갖고 뜨게 된 첫 삽

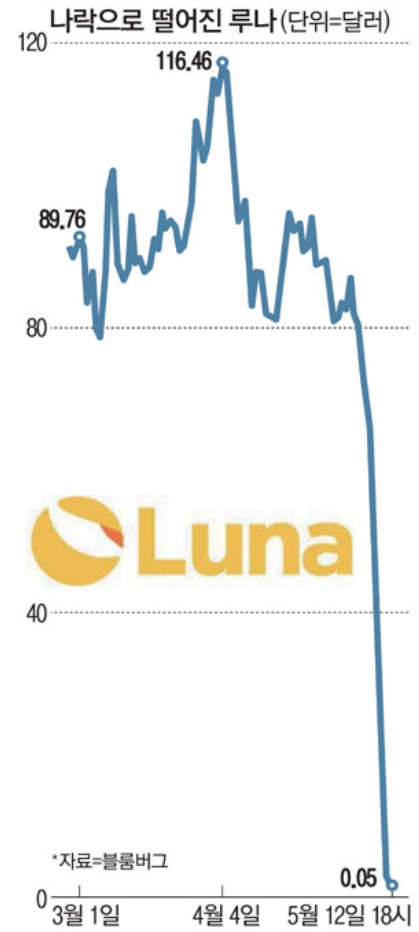
가격 (Price, RSI, MACD, Stochastic)

실적 (매출, 이익, 부채)

물가 (소비자 물가, 생산자 물가)

금리 (단기채 금리, 장기채 금리, 기준 금리)

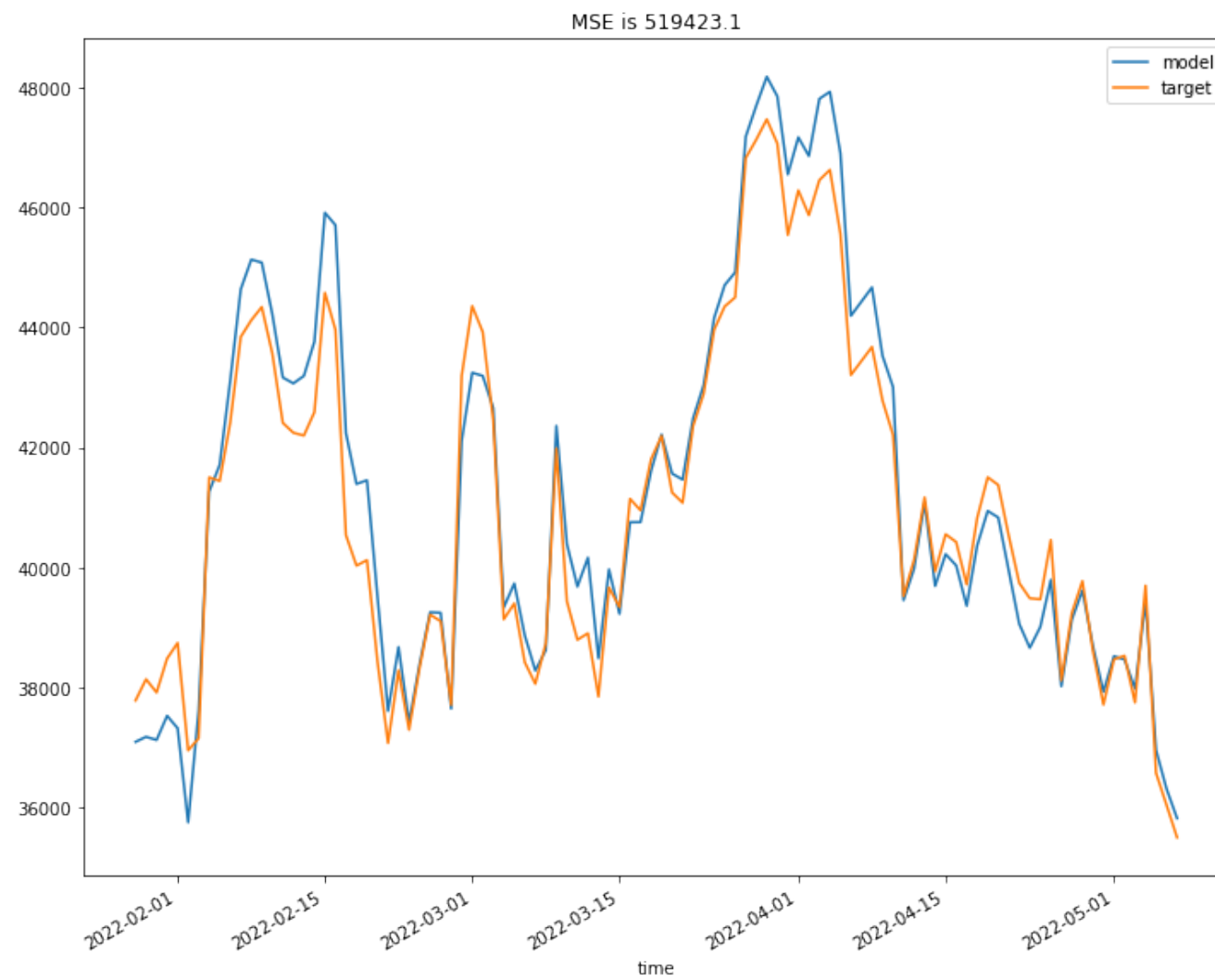




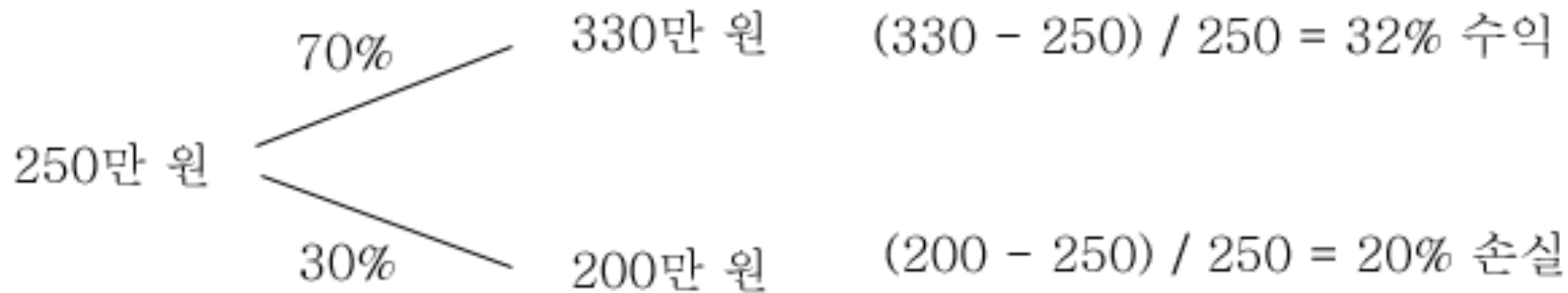
1. 모델은 미래를 완벽히 예측하지 못함
2. 예측이 빗나가면 손실(리스크)이 발생함.
3. 손실은 최소화 하면서 이익은 어떻게 최대화 할까?

이제는 단순히 모델의 예측만으로는 매매를 할 수 없다

## Recent Ridge



## 삼성전자의 주가



## 캘리 공식 (탐욕 공식)

$$\text{투자해야 할 자본의 비중} = \frac{(\text{기대 순이익})}{(\text{이길 경우의 수익})}$$

이길 경우의 순이익: (330만원 - 250만원) = 80만원

기대 순이익: (70% \* 80만원) + (30% \* - 50만원) = 40만원

자본 비중: 50%

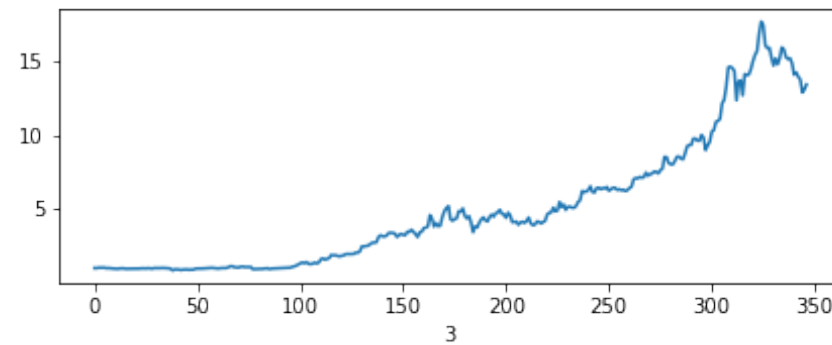
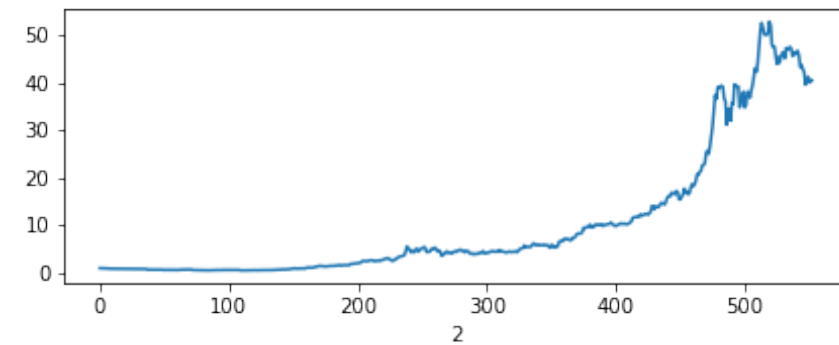
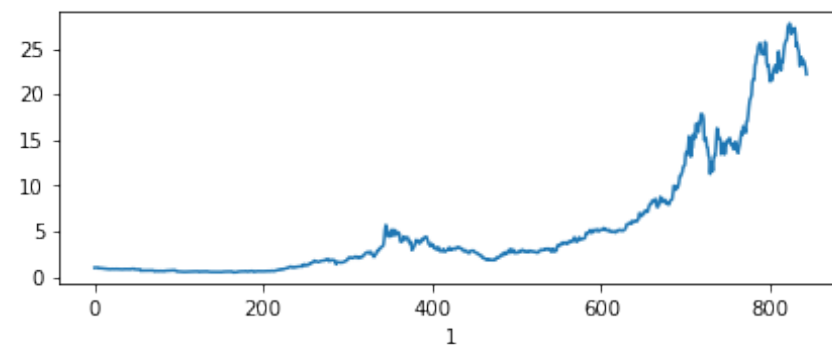
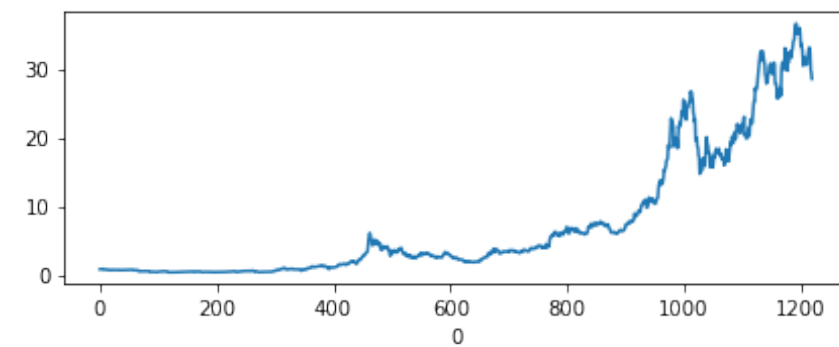
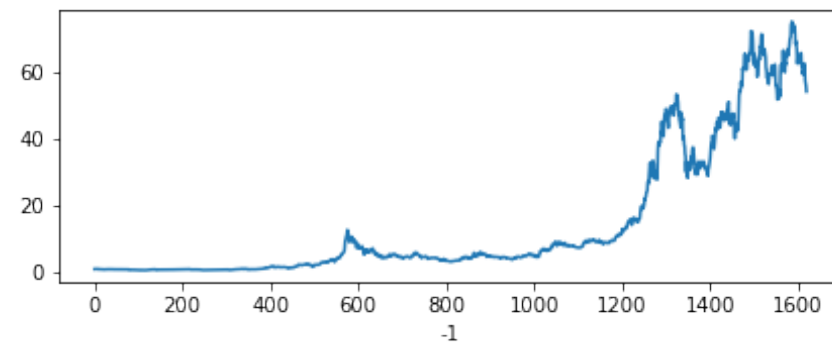
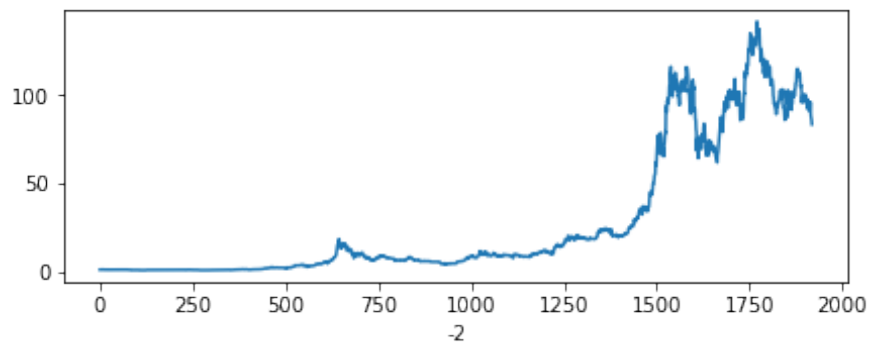
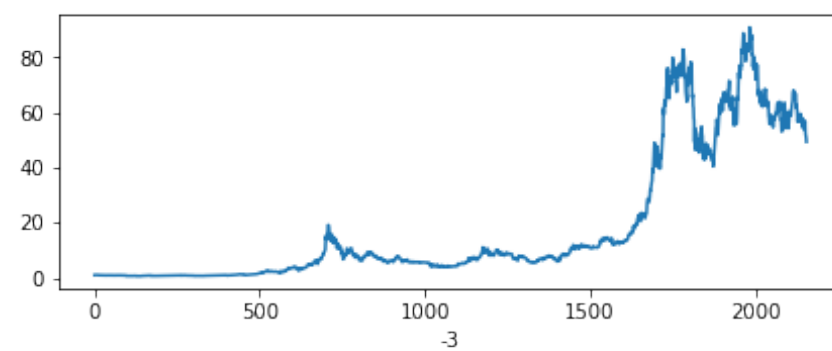
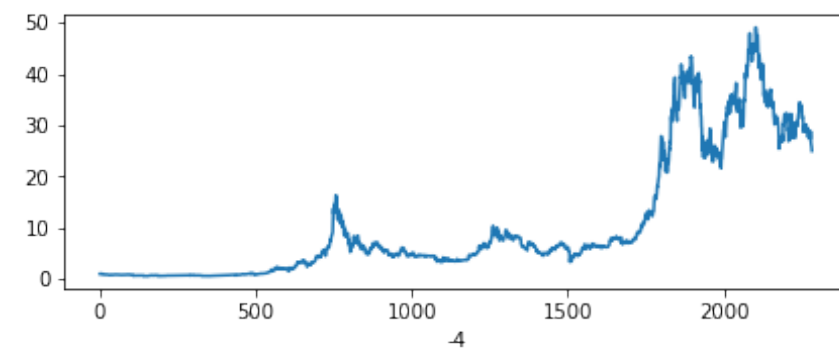
캘리 공식을 실제로 적용하기엔 문제가 많다.

자산 시장에서 명확한 확률과 배당을 구하는 것은 불가능하다.

완벽히 가격을 예측하는 모델

캘리 공식을 통한 배팅 비율 최적화

올인을 신중하게 하는 방식은??

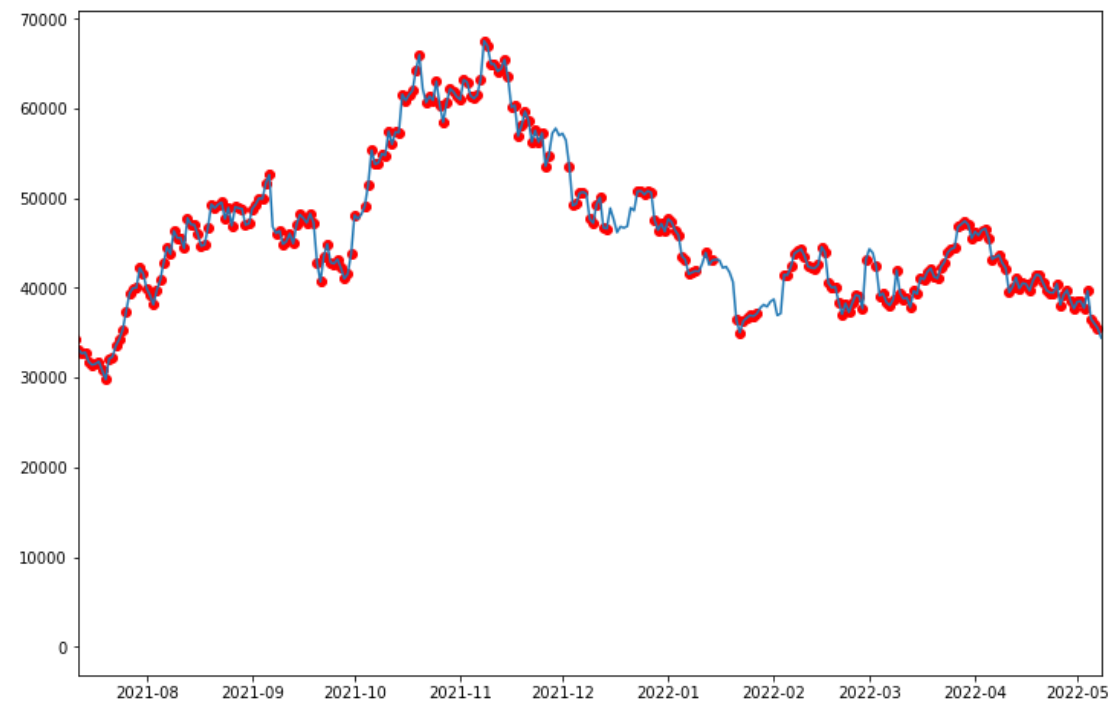




+2%이상 상승을 예측한 지점

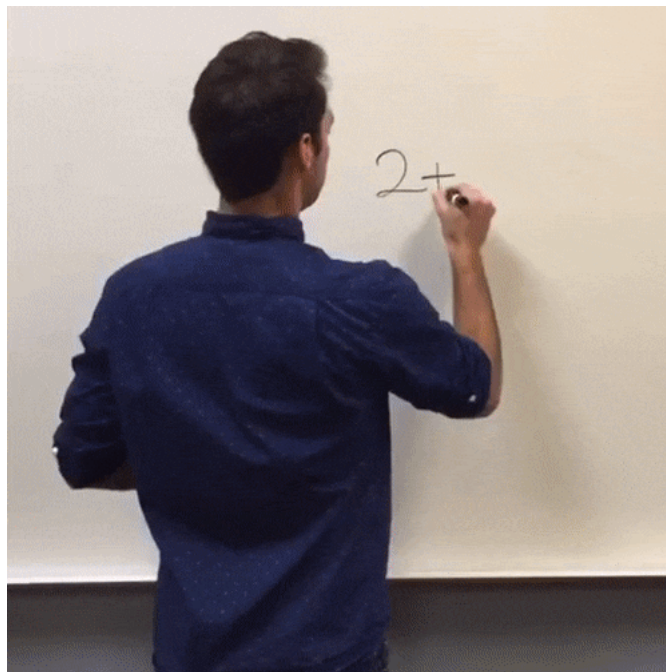


-2%이상 상승을 예측한 지점

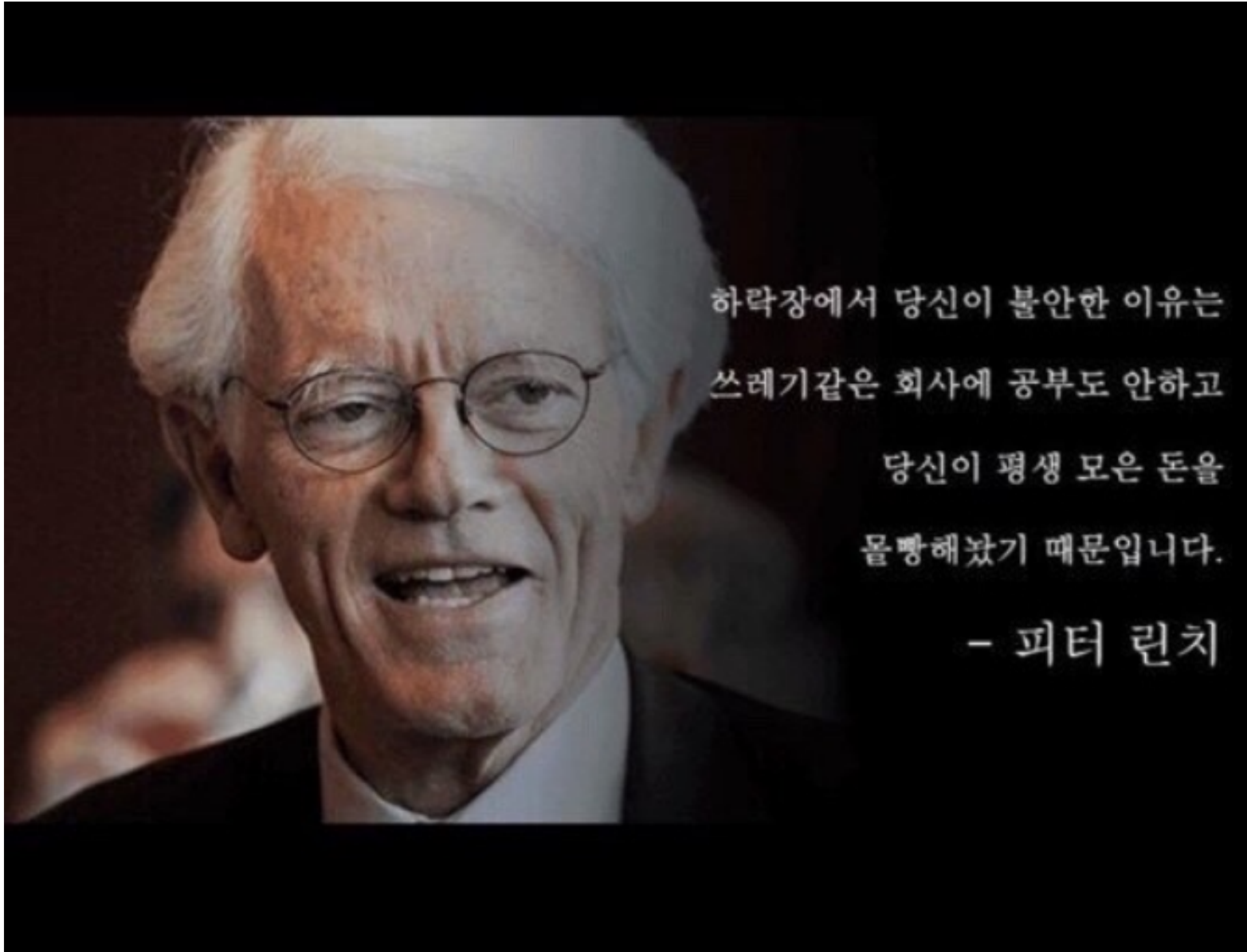


리스크가 커질 수록 수익이 커진다

# 시스템 트레이딩의 어려움



# 시스템 트레이딩의 장점



마치며

