

PROJECT C+E

너에게 모든  
것을 바칩니다.  
최마정애.

# FINAL PROJECT



13차 회의 - 업무 브리핑



업무 브리핑



기타 논의

2022 05/09 비주식팀 업무 브리핑

업무 내용/  
결과

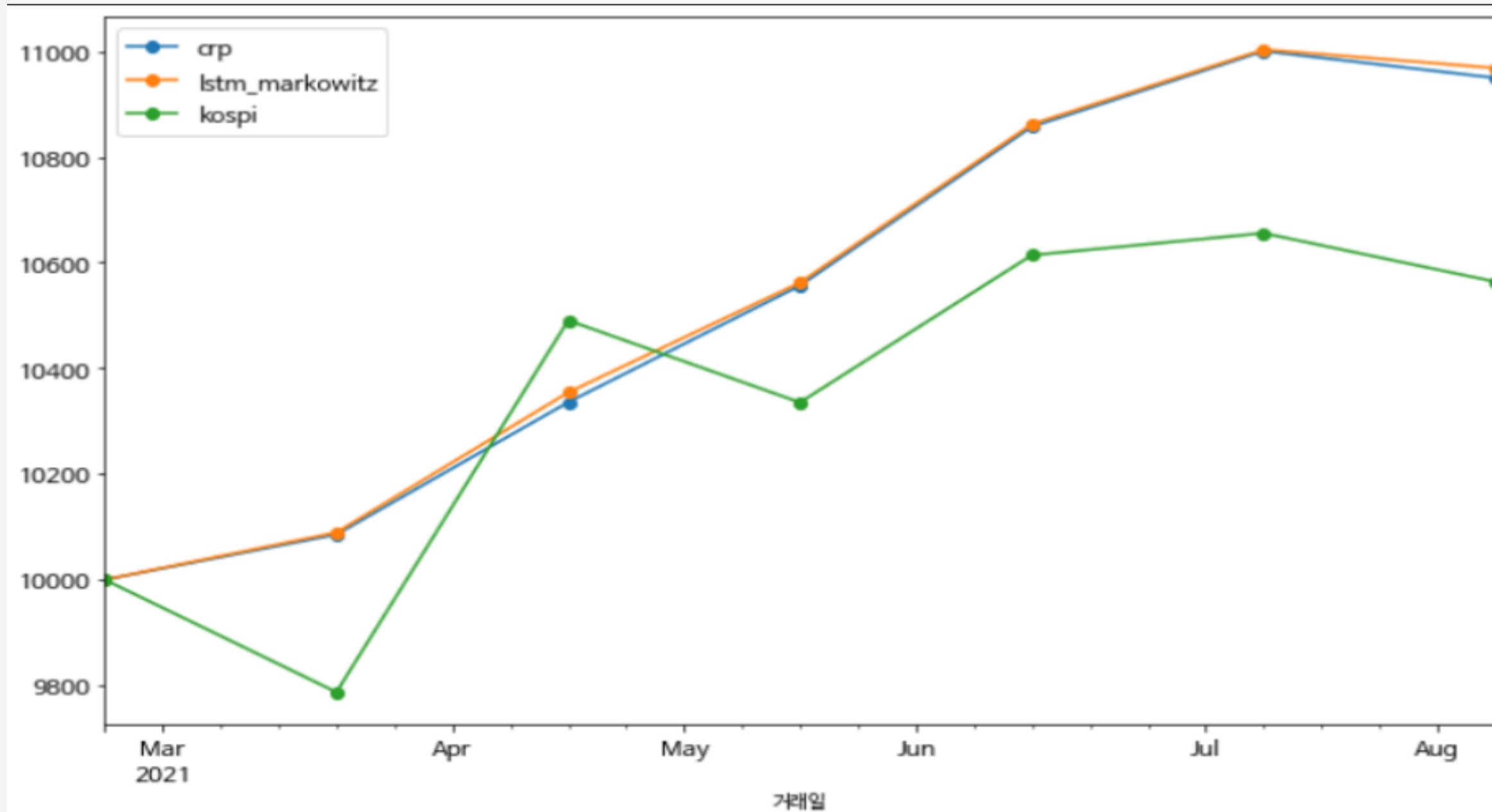
자산 포트폴리오 LSTM 모델 학습  
⇒ 모든 데이터를 학습하여 튜닝을 하다가 결과가 제대로 안나와서 방향성을 바꿈  
cli 2국면 (상승장(회복, 확장), 하락장(둔화, 위축)) 기간을 나눠서 2개의 모델 학습 진행  
⇒ 상승장에서는 코스피보다 높은 수익률, 하락장에서는 손해를 보지않고 꾸준한 수익률을 내는 방향으로 포트폴리오 리밸런싱됨

미비점  
및  
피드백 사항

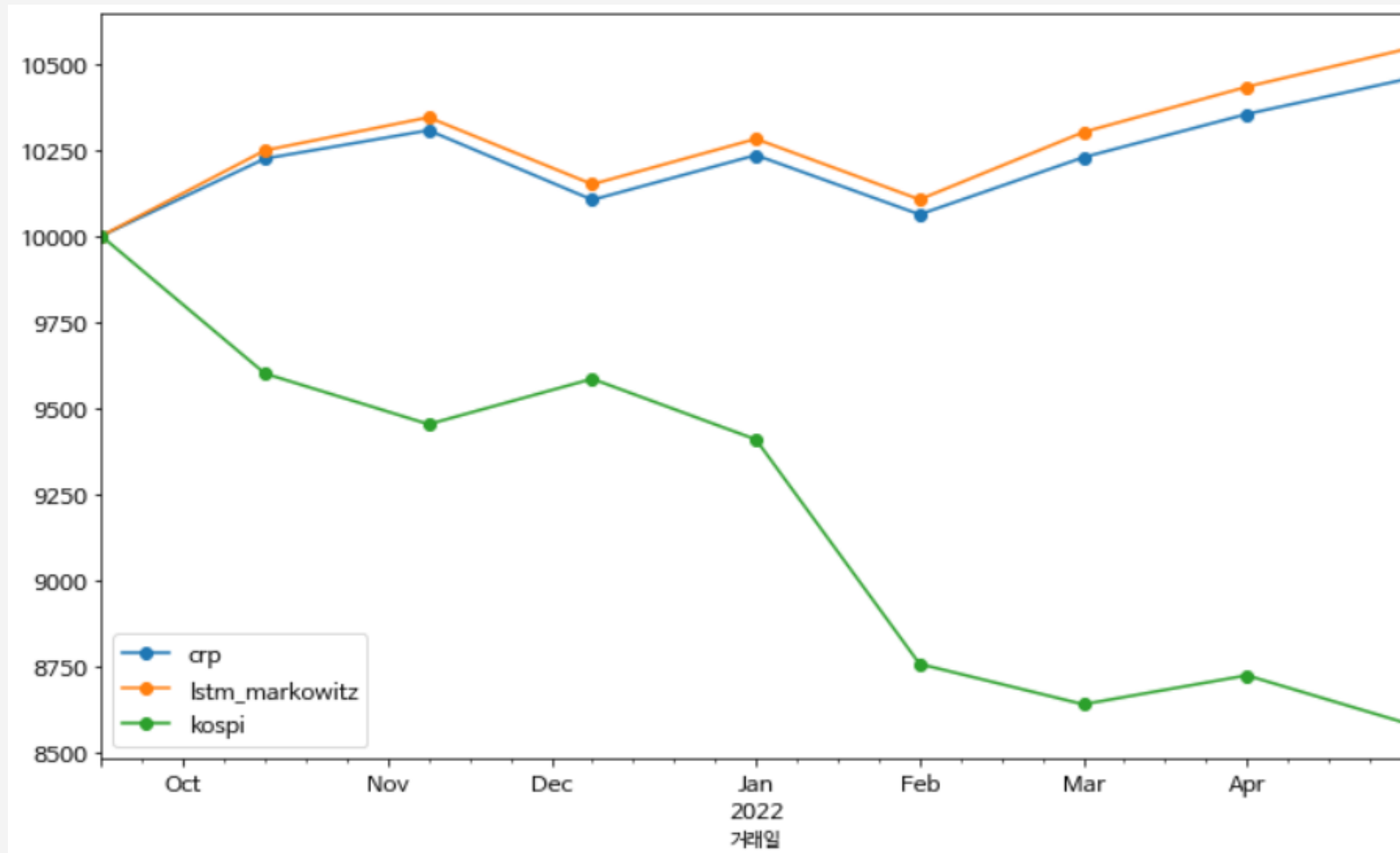
큰 틀로 봤을 때 모델학습의 결과가 유의미했음  
하지만 다른 사람이 만든 코드를 활용해서 수정이 용이하지가 않기 때문에, LSTM 모델 코드를 다시 만들 예정

내일 업무 내용

LSTM 모델 구현 및 튜닝 진행  
기간별로 포트폴리오 성과 측정



상승장



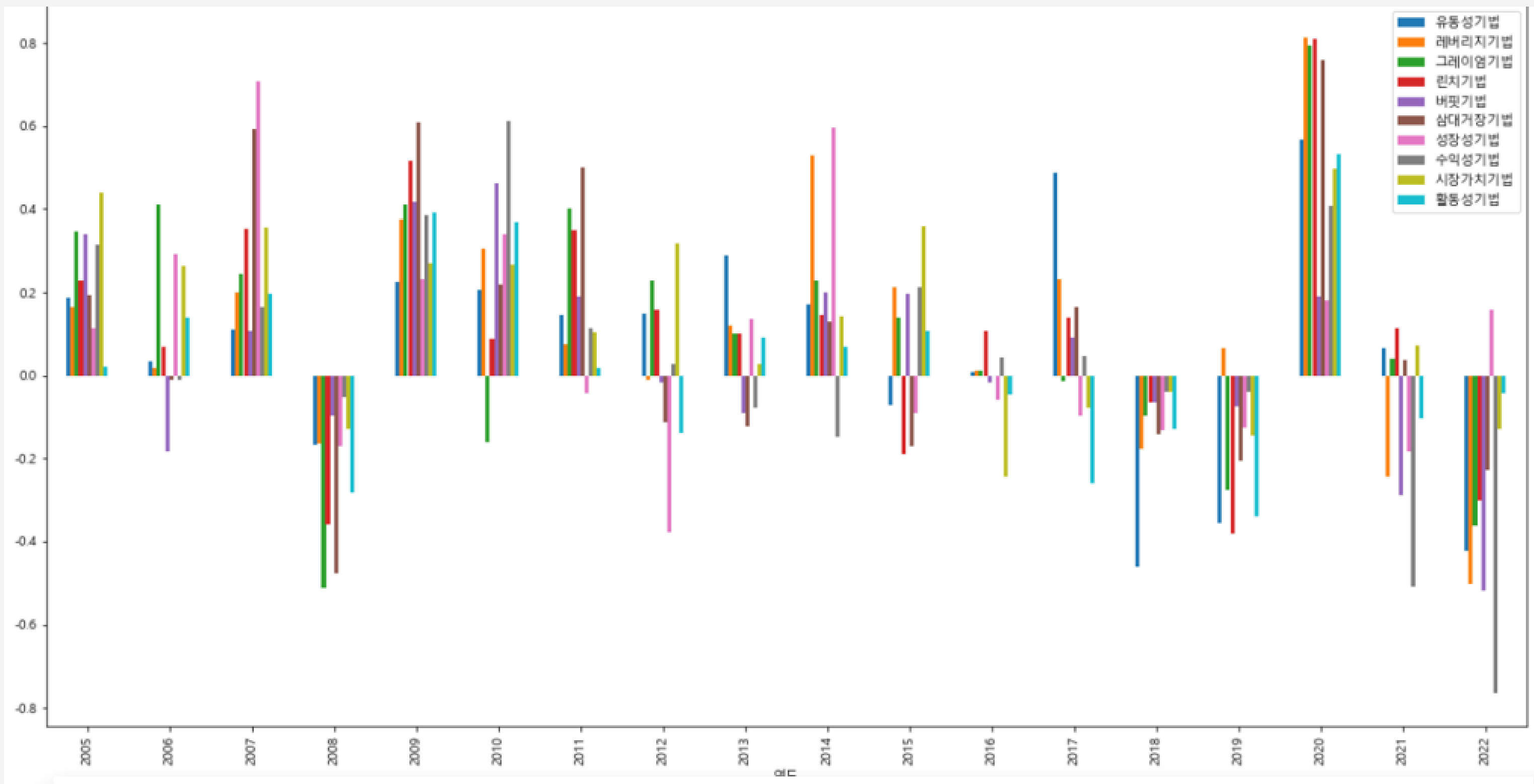
하락장

2022 05/09 주식팀 업무 브리핑

업무 내용/ 결과	<div>1. 받은 분기 데이터로 재무비율 기중 분기별로 리밸런싱된 수익률 추이 대략적으로 확인 (5시부터 (강호)진행중)</div> <div>2. 기술적지표 배경 지식 메인 논문을 토대로 공부및 이용방법 강구 (오전) 전체주식팀원</div> <div>3. 경기국면 지표랑 비교하면서 추세별 패턴 비교후 그사이에 어떤 기술적 지표를 이용하여 백테스팅 할것인지 파악 (4시,토론완료)</div> <div>(둔감시기에 어떤 기술적지표를 이용하여 수익률을 낼수있나/ 손해 최소화)</div> <div>4. 백테스팅 라이브러리 선택 후 사용법 확인 (민형,승희,홍정) 2번단계후 주식팀끼리 토론한 내용으로 백테스팅 실시 및 분석결과 도출 (~ing)</div> <div>결과 -간터차트 진행율 50% 달성.</div> <div>단계적 시행착오 크지않음 계획대로 가는중</div>
미비점 및 피드백 사항	<div>백트레이딩 결과로 나타나지는 수익율 차이</div> <div>에 따라 결과 기대됨. 얼마나 단순연간수익률에 비해 백테스팅한 수익률이 얼마나 차이가 있는지 코딩해서 결과 한번 볼수있게하면 그다음날부터 결합하고,함수 만들고 분석,결과 단계 모델링 할 수 있을 것 같으니,꼼꼼히 체크하면서 진행합시다~~~</div>
내일 업무 내용	<div>백테스팅 분석및 수익률 측정 계속 진행</div>

컨트롤 엔터 파이팅!!





회복 둔감 확장 위축 회복 둔감 확장 회복 회복 위축 확장 둔감 확장 | 둔감 위축 회복 확장 둔감

## 위축 2008년,2014년,2019년

: 총기법종목선정수익률[총기법종목선정수익률['연도']].str.contains('2008')).sort\_values('수익률',ascending=False)

	시작날짜	매도날짜	포트폴리오종목명	수익률	누적수익률	재무비율방식	연도
129	20080321	20090311	['삼성전자', 'POSCO홀딩스', 'LG디스플레이', 'SK텔레콤', 'KT&G']	-0.053560	1.518582	수익성기법	2008
75	20080402	20090323	['LG디스플레이', 'SK텔레콤', 'KT&G', '팬오션', '아모레퍼시픽']	-0.098378	0.910418	버핏기법	2008
147	20080321	20090311	['영풍', '농심홀딩스', '대한유화', '신라교역', '한샘']	-0.128563	2.643336	시장가치기법	2008
21	20080321	20090311	['NAVER', '현대미포조선', '아모레퍼시픽', '에스원', 'SBS']	-0.164384	1.206126	레버리지기법	2008
3	20080319	20090309	['SBS', '아모레G', '엔씨소프트', 'LS네트웍스', '동서']	-0.168331	1.089192	유동성기법	2008
111	20080321	20090311	['한국조선해양', '현대미포조선', '효성', '한온시스템', '태영건설']	-0.170472	2.868808	성장성기법	2008
165	20080321	20090311	['신세계', '삼성중공업', 'HMM', 'SK네트웍스', '포스코인터내셔널']	-0.281630	0.978639	활동성기법	2008
57	20080319	20090309	['고려아연', '대한해운', '퍼시스', '대한유화', '유니드']	-0.359437	1.065453	린치기법	2008
93	20080319	20090309	['대한해운', '퍼시스', '다우기술', '대한유화', '광주신세계']	-0.475360	0.813771	삼대거장기법	2008
39	20080317	20090309	['대한해운', '영풍', '세아홀딩스', '대한유화', '화성산업']	-0.513478	1.005151	그레이엄기법	2008

: 총기법종목선정수익률[총기법종목선정수익률['연도']].str.contains('2014')).sort\_values('수익률',ascending=False)

: 시작날짜 매도날짜 포트폴리오종목명 수익률 누적수익률 재무비율방식 연도





# FINAL PROJECT